

DEPARTEMEN PENDIDIKAN NASIONAL
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA

PROGRAM STUDI : EKONOMI PEMBANGUNAN
DAFTAR No. :

ABSTRAK

SKRIPSI SARJANA EKONOMI

NAMA : HANIF HIMAYA

NIM : 041111024

TAHUN PENYELESAIAN : 2015

JUDUL :

ANALISIS PENGARUH *SHOCK* SUKU BUNGA AMERIKA DAN *KURS DOLLAR* TERHADAP VARIABEL PERBANKAN DI INDONESIA

ISI :

Penelitian ini bertujuan untuk memberikan rekomendasi kebijakan yang tepat terkait dengan stabilitas perbankan. Penelitian ini menganalisis signifikansi variabel perbankan dalam mempengaruhi variabel makroekonomi akibat guncangan eksternal (suku bunga Amerika dan guncangan *kurs* dollar). Penelitian ini menggunakan teknik analisis *Vector Error Correction Model* (VECM), dan menggunakan data dari tahun 1999 kuartal pertama sampai dengan tahun 2014 kuartal kedua. Hasil penelitian menunjukkan bahwa suku bunga Amerika (*The Fed Fund rate*) dan *exchange rate* secara signifikan mempengaruhi variabel perbankan spread suku bunga. Suku bunga Amerika (*The Fed Fund rate*) dan *exchange rate* tidak signifikan mempengaruhi variabel kredit dalam jangka panjang. Dengan melihat penelitian ini diharapkan dapat digunakan sebagai pertimbangan otoritas moneter dalam membuat kebijakan untuk menjaga kestabilan sistem perbankan.

Kata Kunci : makroekonomi, perbankan, guncangan eksternal, *Vector error Correction Model*