

KEMENTERIAN RISET TEKNOLOGI DAN PENDIDIKAN TINGGI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA

PROGRAM STUDI : EKONOMI PEMBANGUNAN
DAFTAR No. :

ABSTRAK
SKRIPSI SARJANA EKONOMI

NAMA : CITTA DEWI ARISANTHI W.K
NIM : 041511133106
TAHUN PENYUSUNAN : 2019

JUDUL:

PENGARUH VOLATILITAS ASIMETRIS NILAI TUKAR RIIL TERHADAP
EKSPOR DAN IMPOR INDONESIA

ISI:

Penelitian mengenai volatilitas nilai tukar dan dampaknya terhadap perdagangan internasional sebagian besar telah dilakukan menggunakan pendekatan simetris. Namun dalam penelitian ini pendekatan asimetris diuji untuk mendapatkan respon yang berbeda ketika volatilitas nilai tukar mengalami penurunan atau mengalami peningkatan. Dua metode digunakan dalam penelitian ini, yaitu; pendekatan *meanthreshold* dan pendekatan *zerethreshold*. Objek dalam penelitian ini menggunakan dua determinan perdagangan nasional yaitu ekspor dan impor, diukur dengan lima komoditas untuk masing-masing model sebagai *proxy* nya. Hasil estimasi melalui ECM menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan diantara pendekatan *meanthreshold* dan *zerethreshold*. Volatilitas nilai tukar negatif berpengaruh negatif terhadap ekspor dan berpengaruh positif terhadap impor dalam jangka panjang. Selain itu, volatilitas nilai tukar positif berpengaruh negatif dan signifikan terhadap ekspor baik dalam jangka panjang maupun jangka pendek

Kata Kunci: Volatilitas Nilai Tukar, Pendekatan Asimetris, Perdagangan Internasional

MINISTRY OF RESEARCH, TECHNOLOGY AND HIGHER EDUCATION
FACULTY OF ECONOMIC AND BUSINESS AIRLANGGA UNIVERSITY

STUDY PROGRAM : ECONOMIC DEVELOPMENT
LIST No. :

ABSTRACT
GRADUATE ECONOMICS THESIS

NAME : CITTA DEWI ARISANTHI W.K
N.I.M. : 041511133106
YEAR OF PREPARATION : 2019

THEME:

*ASYMMETRIC EFFECT OF REAL EXCHANGE RATE VOLATILITY ON
INDONESIAN EXPORT AND IMPORT*

CONTENT:

All previous studies that assessed the impact of exchange rate volatility on trade flows are mostly using the symmetric effect. However, in this study, asymmetric approach are discussed to get a different response. The two methods used in this study, namely; mean threshold approach and zero threshold approach. The object in this study uses two international trade determinants, exports and imports. The estimation results through Error Correction Model (ECM) show there is no difference between the mean threshold approach and the zero threshold approach. In addition, the negative volatility are negatively affects exports and positively affects imports in the long run. While the positive volatility are negatively affects exports both in the short run long run.

Keywords: *Exchange Rate Volatility, Asymmetric Approach, International trade*