

RESPON NILAI TUKAR TERHADAP PERUBAHAN VARIABEL MAKRO
EKONOMI INDONESIA: PENDEKATAN *VECTOR AUTOREGRESSION* (VAR)

Skripsi S1 oleh: Muhammad Iqbal

Pembimbing : Indrawari, SE, MA, Ph.D.

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk melihat dan menganalisis respon nilai tukar terhadap perubahan variabel makro ekonomi Indonesia. Penelitian ini menggunakan data time series kuartalan dari tahun 1998 sampai 2014. Penelitian ini menggunakan metode *Vector Autoregression (VAR)*. Hasil dari penelitian ini adalah bahwa nilai tukar merespon guncangan dari masing-masing variabel ekonomi dengan bergerak menuju kestabilan. Artinya, kestabilan dari fluktiasi nilai tukar sangat penting untuk mengontrol perekonomian. Variabel yang perlu diperhatikan selain fluktiasi nilai tukar adalah pengaruh dari suku bunga luar negeri yang memberikan pengaruh terhadap perekonomian dalam negeri. Namun jangan sampai melupakan pengaruh variabel makro ekonomi Indonesia yang lainnya.

Kata Kunci: Nilai Tukar, *GDP*, *CPI*, *IR_US* dan *IR*