



UNIVERSITAS ANDALAS



PANDEMI COVID-19 DAN VOLATILITAS NILAI TUKAR

DI KAWASAN ASEAN

SKRIPSI

Assyfa Aulia Fajri Z.A

2010512025

DEPARTEMEN EKONOMI

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

PADANG

2024

PANDEMI COVID-19 DAN VOLATILITAS NILAI TUKAR DI KAWASAN ASEAN

oleh
Assyfa Aulia Fajri Z.A
2010512025

Diajukan ke Departemen Ekonomi,
Pada tanggal 25 Juli 2024, untuk memenuhi sebahagian
Syarat dalam mencapai derajat
Sarjana Ekonomi

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk melihat pengaruh pandemi COVID-19 terhadap nilai tukar di kawasan ASEAN. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder dalam bentuk data panel dengan periode waktu bulan Januari 2020 hingga Desember 2022. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode *Generalized Method of Moments* (GMM). Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah volatilitas nilai tukar sebagai variabel dependen, serta variabel dependennya yaitu intervensi pemerintah, angka positif Covid-19, tingkat suku bunga, dan indeks harga konsumen, serta diolah menggunakan *software* Stata 14. Hasil penelitian ini menemukan bahwa angka positif Covid-19 dan tingkat suku bunga tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap volatilitas nilai tukar di kawasan ASEAN. Variabel intervensi pemerintah memiliki pengaruh yang negatif dan signifikan terhadap volatilitas nilai tukar di kawasan ASEAN. Variabel indeks harga konsumen memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap volatilitas nilai tukar di kawasan ASEAN.

Kata Kunci: Volatilitas Nilai Tukar, Intervensi Pemerintah, Covid-19, Suku Bunga, Indeks Harga Konsumen, GMM, ASEAN.

Pembimbing Skripsi: Rini Rahmahdian S, SE., MSE