



UNIVERSITAS TARUMANAGARA

FAKULTAS EKONOMI

JAKARTA

SKRIPSI

**ANALISIS FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI
VOLATILITAS KURS IDR/ USD TAHUN 2004 - 2015**

DIAJUKAN OLEH :

NAMA : ROCKY DWI

NPM : 115130178

UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT-SYARAT

GUNA MENCAPAI GELAR

SARJANA EKONOMI

2017

ABSTRACT

**TARUMANAGARA UNIVERSITY
FACULTY OF ECONOMY
JAKARTA**

- (A) ROCKY DWI
- (B) ANALISIS FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI VOLATILITAS KURS IDR/ USD TAHUN 2004 - 2015
- (C) xiv + 95 *pages*, 2017, 5 *tables*, 2 *pictures*, 12 *attachments*
- (D) *FINANCE MANAGEMENT*
- (E) ***Abstract:*** *This study examines the determinants that affecting exchange rate volatility. In this case IDR/ USD exchange rate is taken as the study subject, starting from 2004 – 2015. A GARCH model is used to examines the outcome and the results show that trade openness, reserve asset, stock market index and productivity significantly affect exchange rate volatility.*
- (F) *Reference List : 92 (1961-2016)*
- (G) Dr. Ishak Ramli, S.E., M.M.

ABSTRAK

UNIVERSITAS TARUMANAGARA
FAKULTAS EKONOMI
JAKARTA

(H) ROCKY DWI

(I) ANALISIS FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI
VOLATILITAS KURS IDR/ USD TAHUN 2004 - 2015

(J) xiv + 95 halaman, 2017, tabel 5, gambar 2, lampiran 12

(K) MANAJEMEN KEUANGAN

(L) **Abstrak:** Penelitian ini bertujuan untuk menguji faktor yang memiliki pengaruh terhadap volatilitas kurs IDR/ USD selama periode 2004 – 2015. Penelitian dilakukan dengan menggunakan model GARCH dan hasil dari penelitian menunjukkan *trade openness*, *reserve asset*, *stock market index* dan *productivity* memiliki pengaruh signifikan terhadap volatilitas kurs.

(M) Daftar Pustaka: 92 (1961-2016)

(N) Dr. Ishak Ramli, S.E., M.M.