

## DAFTAR ISI

<b>ABSTRAK</b> .....	i
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	ii
<b>UCAPAN TERIMA KASIH</b> .....	iii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	v
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	viii
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	ix
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	x
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	5
1.3 Tujuan Penulisan .....	6
1.4 Sistematika penulisan.....	6
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA</b>	
2.1 Konsep Dasar Runtun Waktu.....	8
2.1.1 Plot data .....	8
2.1.2 Fungsi Autokorelasi.....	9
2.1.3 Fungsi Autokorelasi Parsial.....	10

2.2	Analisis regresi .....	11
2.2.1	Regresi linier sederhana .....	11
2.2.1.1	Penaksiran Parameter .....	12
2.2.1.2	Uji t .....	14
2.2.1.3	Ukuran <i>Goodness Of Fit</i> ( $R^2$ ) .....	15
2.2.2	Regresi Linier Ganda .....	16
2.2.2.1	Asumsi-asumsi dalam Regresi Linier Ganda .....	17

### **BAB III ERROR CORRECTION MODEL**

3.1	Teori <i>Error Correction Model</i> .....	22
3.1.1	Uji Kestasioneran .....	23
3.1.2	Uji Derajat Integrasi .....	25
3.1.3	Uji Kointegrasi .....	25
3.1.4	Uji Kausalitas Granger .....	27
3.2	Pemodelan <i>Error Correction Model</i> .....	28

### **BAB IV STUDI KASUS**

4.1	Teori Inflasi .....	31
4.2	Teori Permintaan Uang Keynes .....	32
4.3	Tingkat Suku Bunga .....	33
4.4	Teori Paritas Daya Beli .....	34
4.5	Peubah Penelitian dan Definisi Operasional .....	34
4.6	Jenis dan Sumber Data .....	35

4.7	Metode Analisis.....	36
4.8	Uji Kestasioneran .....	41
4.8.1	Plot Data .....	42
4.8.2	Uji Derajat Integrasi .....	42
4.9	Pengujian Kointegrasi .....	44
4.10	Uji Kausalitas Granger.....	45
4.11	Pengujian Model Dinamis <i>Error Correction Model</i> .....	47
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>		
5.1	Kesimpulan.....	51
5.2	Saran .....	51
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>53</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>		<b>54</b>
<b>RIWAYAT HIDUP</b>		

## DAFTAR TABEL

Tabel 1	Uji Normalitas .....	36
Tabel 2	Uji Keberartian Koefisien.....	37
Tabel 3	Uji Linieritas.....	38
Tabel 4	Uji Multikolinieritas .....	38
Tabel 5	Uji Autokorelasi .....	40
Tabel 6	Uji Autokorelasi pada Data yang ditransformasi .....	41
Tabel 7	Koefisien Regresi .....	41
Tabel 8	Uji Akar Unit untuk Inflasi.....	43
Tabel 9	Uji Akar Unit untuk Suku Bunga .....	44
Tabel 10	Uji Akar Unit untuk JUB .....	44
Tabel 11	Uji Kointegrasi .....	45
Tabel 12	Uji Kausalitas antara Inflasi dan Suku Bunga .....	46
Tabel 13	Uji Kausalitas antara Inflasi dan JUB .....	46
Tabel 14	Estimasi Jangka Panjang .....	48
Tabel 15	Estimasi Jangka Pendek .....	49

**DAFTAR GAMBAR**

Gambar 1 *Scatter Plot* .....39



## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 .... Data Faktor-faktor yang Mempengaruhi Inflasi di Indonesia Periode Januari 2003 sampai September 2005.....	54
Lampiran 2 ..... Hasil output plot data inflasi, JUB dan suku bunga pada program Minitab 13.....	56
Lampiran 3..... Hasil output plot Fak dan Fakp inflasi, JUB dan sukubunga pada program Minitab 13 .....	57
Lampiran 4.....Hasil output uji akar unit untuk masing-masing peubah pada tingkat level I(0) dengan menggunakan program E-views .....	60
Lampiran 5Tabel Durbin Watson	61
Lampiran 6Tabel distribusi	62