

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR PENGESAHAN	
LEMBAR PERNYATAAN	
KATA PENGANTAR.....	i
UCAPAN TERIMAKASIH.....	ii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
DAFTAR ISI.....	vi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Batasan Masalah.....	4
1.4 Tujuan Penulisan.....	4
1.5 Manfaat Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	6
2.1 Metode Runtun Waktu.....	6
2.2 <i>Vector Autoregressive</i> (VAR).....	6
2.3 <i>Error Correction Model</i> (ECM).....	7
2.4 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	8
2.5 Nilai Tukar Mata Uang (Kurs).....	9
2.6 Inflasi.....	11
BAB III <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM).....	13
3.1 Tahapan-Tahapan Mengestimasi dengan VECM.....	13
3.1.1 Uji Stasioneritas Data.....	13

3.1.2	Penentuan Lag Optimal.....	15
-------	----------------------------	----

3.1.3 Uji Kointegrasi.....	16
3.1.3.1 Uji Engle-Granger.....	16
3.1.3.2 Uji Johansen.....	16
3.1.4 Analisis Kausalitas (Uji Granger).....	18
3.1.5 Pemodelan <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM).....	20
3.1.6 <i>Impulse Response Function</i> (IRF).....	21
3.1.7 <i>Variance Decomposition</i>	21
BAB IV STUDI KASUS.....	23
4.1 Deskripsi Data.....	23
4.2 Uji Stasioneritas.....	23
4.3 Penentuan <i>Lag</i> Optimal.....	27
4.4 Uji Kointegrasi Johansen.....	28
4.5 Analisis Kausalitas Granger (<i>Granger Causality Test</i>).....	29
4.6 <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM).....	31
4.7 <i>Impulse Response Function</i> (IRF).....	33
4.8 <i>Variance Decomposition</i>	37
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	40
5.1 Kesimpulan.....	40
5.2 Saran.....	41
DAFTAR PUSTAKA.....	42
LAMPIRAN.....	44
RIWAYAT HIDUP	