

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR PERSAMAAN	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	11
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	12
1.4 Sistematika Penulisan.....	13
BAB II KAJIAN PUSTAKA	16
2.1 Landasan Teori	16
2.1.1 Nilai Tukar.....	16
2.1.1.1 Sistem Nilai tukar (<i>Exchange Rate System</i>).....	17
2.1.1.2 Teori Nilai Tukar.....	26
2.1.1.3 Teori nilai Tukar dengan Pendekatan Moneter	28
2.1.2 Jumlah Uang Beredar (JUB).....	36
2.1.2.1 Teori Kuantitas Irving Fisher	40
2.1.2.2 Hubungan Jumlah Uang Beredar dengan Nilai Tukar	40
2.1.3 Produk Domestik Bruto (PDB).....	41
2.1.3.1 Hubungan Produk Domestik Bruto dan Nilai Tukar.....	42
2.1.4 Suku Bunga.....	42

2.1.4.1	Teori Suku Bunga.....	45
2.1.4.2	Hubungan Suku Bunga dan Nilai Tukar	46
2.1.5	Inflasi.....	46
2.1.5.1	Sifat Inflasi.....	48
2.1.5.2	Penyebab Inflasi.....	49
2.1.5.3	Hubungan Inflasi dan Nilai Tukar.....	50
2.2	Penelitian Terdahulu.....	50
2.3	Kerangka Pemikiran.....	54
2.4	Hipotesis.....	54
BAB III	METODE PENELITIAN	58
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	58
3.2	Jenis dan Sumber Data	60
3.3	Metode Pengumpulan Data	61
3.4	Metode Analisis.....	62
3.4.1	Vector Error Correction Model (VECM).....	62
3.4.2	Uji Stasioneritas Data	64
3.4.3	Penentuan <i>Lag</i> Optimal	66
3.4.4	Pengujian Kointegrasi.....	67
3.4.5	Pemodelan VECM.....	69
3.4.6	Pengujian Model.....	72
3.4.7	Uji Normalitas	72
3.4.8	Uji Multikolinearitas.....	73
3.4.9	Uji Autokorelasi.....	74
3.4.10	Uji Heteroskedastisitas.....	75
3.4.11	Uji Stabilitas.....	76
BAB IV	HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN	78
4.1	Objek Penelitian	78
4.2	Analisis Data	79
4.2.1	Uji Stasioneritas.....	79
4.2.2	Penentuan Lag Optimal	81
4.2.3	Uji Kointegrasi	82

4.2.4 Uji Asumsi Klasik dan Uji stabilitas.....	84
4.2.4.1 Normalitas	84
4.2.4.2 Multikolinearitas	86
4.2.4.3 Autokorelasi	87
4.2.4.4 Heteroskedastisitas	89
4.2.4.5 Uji Stabilitas.....	90
4.3 Interpretasi Hasil	92
4.3.1 Hubungan Kesimbangan Jangka Panjang (Persamaan Kointegrasi)....	92
4.3.2 Dinamika Jangka pendek dan Mekanisme Koreksi.....	94
4.3.3 Impulse Response Function (IRF).....	95
4.3.4 Variance Decomposition (VD)	96
BAB V PENUTUP.....	98
5.1 Kesimpulan.....	98
5.2 Keterbatasan Penelitian	100
5.3 Saran.....	101
5.3.1. Scientific Relevant.....	101
5.3.2. Policy Relevant.....	102
DAFTAR PUSTAKA.....	103
Lampiran (Hasil Eviews).....	106

