

## DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL	
HALAMAN PERSETUJUAN .....	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....	iv
<i>ABSTRACT</i> .....	v
ABSTRAKSI .....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR TABEL .....	xiii
DAFTAR GAMBAR .....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN .....	xv
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	1
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	31
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian .....	34
1.4 Sistematika Penulisan .....	35
<b>BAB II TELAAH PUSTAKA</b> .....	37
2.1 Landasan Teori .....	37
2.1.1 Inflasi .....	37
2.1.2 Pengukuran inflasi .....	38
2.1.3 Teori inflasi .....	40
2.1.4 Penggolongan inflasi.....	50
2.1.5 Efek inflasi .....	58
2.1.6 Uang .....	60
2.1.7 Definisi dan ciri-ciri uang.....	60
2.1.8 Fungsi uang .....	61
2.1.9 Jenis-jenis uang.....	62
2.1.10 Penawaran Uang .....	62
2.1.11 Permintaan Uang .....	64
2.1.12 Kebijakan Moneter .....	66
2.1.13 Target Kebijakan Moneter .....	66
2.1.14 Indikator Kebijakan Moneter.....	67
2.1.15 Instrumen kebijakan moneter .....	67
2.1.16 Mekanisme Transmisi Kebijakan Moneter.....	69
2.1.17 Tenggang Waktu (lag) efek dari Kebijakan Moneter...	77
2.1.18 Kurs .....	79
2.1.19 Faktor-faktor yang mempengaruhi kurs.....	80
2.1.20 Sistem Nilai Tukar .....	83
2.1.21 Suku bunga .....	84
2.1.22 Suku Bunga riil vs nominal .....	86
2.2 Pengaruh JUB, kurs, suku bunga, dan harga beras terhadap inflasi .....	87

2.2.1	Pengaruh jumlah uang beredar terhadap inflasi .....	87
2.1.2	Pengaruh nilai tukar (kurs) terhadap inflasi .....	88
2.1.3	Pengaruh suku bunga terhadap inflasi.....	89
2.1.4	Pengaruh harga beras terhadap inflasi .....	91
2.3	Penelitian Terdahulu .....	94
2.4	Kerangka Pemikiran .....	103
2.5	Hipotesis .....	104
<b>BAB III</b>	<b>METODE PENELITIAN</b> .....	105
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional .....	105
3.2	Jenis dan Sumber Data .....	108
3.3	Metode Pengumpulan Data .....	109
3.4	Metode Analisis .....	109
3.4.1	Analisis Statistik Deskriptif .....	110
3.4.2	Analisis Regresi Linier Berganda dengan metode kuadrat terkecil biasa (OLS).....	113
3.4.3	Asumsi Klasik .....	114
3.4.4	Deteksi Penyimpangan Asumsi Klasik .....	115
3.4.4.1	Deteksi Multikolinieritas .....	116
3.4.4.2	Deteksi Autokorelasi.....	117
3.4.4.3	Deteksi Heteroskedastisitas .....	118
3.4.4.4	Deteksi Normalitas .....	119
3.4.5	Uji Statistik .....	119
3.4.5.1	Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	119
3.4.5.2	Uji Signifikansi Simultan (Uji F) .....	120
3.4.5.3	Uji Signifikansi Individu (Uji t) .....	121
3.4.6	Model ARCH dan GARCH .....	123
3.4.6.1	Spesifikasi ARCH Dasar .....	127
3.4.6.1.1	Model GARCH (1,1) .....	128
3.4.6.1.2	Model GARCH (q,p) .....	129
3.4.6.1.3	Model GARCH-M .....	129
3.4.6.1.4	Regressors dalam persamaan varians .....	130
3.4.6.1.5	Asumsi distribusi .....	131
3.4.6.2	Mengestimasi model ARCH dengan menggunakan <i>software</i> Eviews .....	131
3.4.6.2.1	Persamaan rata-rata ( <i>mean equation</i> ) .....	131
3.4.6.2.2	Persamaan varians ( <i>variance equation</i> ) .....	132
3.4.6.3	Contoh GARCH (1,1) .....	133
3.4.6.4	Model ARCH Tambahan .....	134
3.4.6.4.1	Model Integrated GARCH (IGARCH) .....	135
3.4.6.4.2	Model Threshold GARCH (TARCH) .....	136
3.4.6.4.3	Model Exponential GARCH	

	(EGARCH) .....	136
	3.4.6.4.4 Model Power ARCH (PARCH).....	137
	3.4.6.4.5 Model Component GARCH (CGARCH) .....	138
	3.4.6.5 Deteksi Penyimpangan Asumsi Klasik Model ARCH.....	139
	3.4.7 Kriteria Pemilihan Model Terbaik .....	140
<b>BAB IV</b>	<b>HASIL DAN PEMBAHASAN</b> .....	143
4.1	Deskripsi Variabel Penelitian.....	143
4.1.1	Perkembangan inflasi .....	143
4.1.2	Perkembangan Jumlah uang beredar secara luas (M2).....	148
4.1.3	Perkembangan kurs rupiah terhadap US \$ .....	151
4.1.4	Perkembangan suku bunga .....	154
4.1.5	Perkembangan harga beras .....	158
4.2	Analisis Data .....	162
4.2.1	Analisis Statistik Deskriptif .....	162
4.2.2	Hasil Regresi model OLS .....	163
	4.2.2.1 Deteksi Multikolinieritas .....	165
	4.2.2.2 Deteksi Autokorelasi .....	166
	4.2.2.3 Deteksi Heteroskedastisitas .....	167
	4.2.2.4 Deteksi Normalitas .....	168
4.2.3	Hasil estimasi regresi model ARCH/GARCH.....	168
4.2.4	Hasil regresi model ARCH/GARCH terbaik .....	172
	4.2.4.1 Deteksi Autokorelasi .....	174
	4.2.4.2 Deteksi spesifikasi persamaan varians .....	177
	4.2.4.3 Deteksi heteroskedastisitas .....	178
	4.2.4.4 Deteksi normalitas .....	178
4.2.5	Pengujian statistik analisis regresi .....	179
	4.2.5.1 Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	179
	4.2.5.2 Pengujian Koefisien Regresi secara individual (Uji t) .....	179
4.3	Interpretasi Hasil .....	180
4.3.1	Pengaruh JUB terhadap inflasi .....	181
4.3.2	Pengaruh kurs rupiah/US\$ terhadap inflasi.....	182
4.3.3	Pengaruh suku bunga terhadap inflasi .....	184
4.3.4	Pengaruh harga beras terhadap inflasi .....	185
<b>Bab V</b>	<b>PENUTUP</b> .....	186
5.1	Kesimpulan .....	186
5.2	Saran .....	187
	DAFTAR PUSTAKA .....	189
	DAFTAR LAMPIRAN .....	192