

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
ABSTRAK.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	9
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	10
1.4 Sistematika Penulisan.....	12
BAB II TELAAH PUSTAKA	14
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu.....	14
2.1.1 Inflasi.....	14
2.1.1.1 <i>Demand Side Inflation</i>	15
2.1.1.2 <i>Inflation Targeting Framework</i>	17
2.1.2 Kebijakan Moneter.....	18
2.1.2.1 Kebijakan Moneter Ekspansif	19
2.1.2.2 Kebijakan Moneter Kontraktif	20
2.1.3 Mekanisme Transmisi Moneter.....	20
2.1.4 Saluran Jumlah Uang Beredar.....	22
2.1.4.1 Teori Kuantitas	23
2.1.5 Saluran Suku Bunga.....	25
2.1.5.1 Efek Fisher	26

2.1.6	Nilai Tukar	28
2.1.6.1	Hukum Satu Harga (<i>The Law of One Price</i>)	33
2.1.7	Penelitian Terdahulu	34
2.2	Kerangka Pemikiran Teori	42
2.3	Hipotesis	44
BAB III METODE PENELITIAN.....		45
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	45
3.2	Jenis dan Sumber Data	46
3.3	Metode Pengumpulan Data	47
3.4	Metode Analisis.....	47
3.4.1	Model Empiris Vector Error Correction Model (VECM).....	50
3.4.2	Prosedur Vector Error Correction Model (VECM)	53
3.4.2.1	Uji Stasioneritas	53
3.4.2.2	Penentuan <i>Lag</i> Optimal	54
3.4.2.3	Uji Stabilitas	55
3.4.2.4	Uji Kointegrasi	55
3.4.2.5	Uji Kausalitas Granger	56
3.4.2.6	<i>Impulse Response Function</i>	57
3.4.2.7	Variance Decomposition (VD).....	58
3.4.2.8	Uji Normalitas	58
3.4.3	Deteksi Penyimpangan Klasik	59
3.4.3.1	Uji Heteroskedastisitas	59
3.4.3.2	Uji Autokorelasi	60
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		62
4.1	Deskripsi Objek Penelitian	62
4.1.1	Perkembangan Laju Inflasi di Indonesia.....	62
4.1.2	Perkembangan Jumlah Uang Beredar di Indonesia	63
4.1.3	Perkembangan Suku Bunga di Indonesia.....	65
4.1.4	Perkembangan Nilai Tukar di Indonesia.....	66
4.2	Analisis Data	68
4.2.1	Uji Stasioneritas	68

4.2.2	Uji <i>Lag</i> Optimal	69
4.2.3	Uji Stabilitas.....	70
4.2.4	Uji Kointegrasi	71
4.2.5	Uji Kausalitas Granger	73
4.2.6	Vector Error Correction Model (VECM).....	74
4.2.7	Uji <i>Impulse Response Function</i> (IRF).....	77
4.2.8	Uji Variance Decomposition (VD)	79
4.2.9	Uji Normalitas	80
4.2.10	Deteksi Penyimpangan Klasik	81
4.3	Interpretasi Hasil	83
4.3.1	Hubungan Antara Inflasi dan Jumlah Uang Beredar (M1)	83
4.3.2	Hubungan Antara Inflasi dan Suku Bunga.....	84
4.3.3	Hubungan Antara Inflasi dan Nilai Tukar.....	85
BAB V PENUTUP.....		88
5.1	Kesimpulan.....	88
5.2	Saran	90
DAFTAR PUSTAKA		91
LAMPIRAN.....		95

SEMARANG
FEB UNDIP