

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL	
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAKSI	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	31
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	34
1.4 Sistematika Penulisan	35
BAB II TELAAH PUSTAKA	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
BAB III	METODE PENELITIAN	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 meng- gunakan <i>software</i> Eviews	131
3.4.6.2.1	Persamaan rata-rata (<i>mean</i> <i>equation</i>)	131
3.4.6.2.2	Persamaan varians (<i>variance</i> <i>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
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN	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
Bab V	PENUTUP	186
5.1	Kesimpulan	186
5.2	Saran	187
	DAFTAR PUSTAKA	189
	DAFTAR LAMPIRAN	192