

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINILITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
DAFTAR NOTASI.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Tujuan Penelitian	13
1.4 Manfaat Penelitian.....	14
1.5 Sistematika Penulisan	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	17
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu.....	17
2.1.1 <i>Small Open Economy New Keynesian Model</i>	17
2.1.2 Preferensi Kebijakan Moneter Bank Sentral	33
2.1.3 Model Aturan Kebijakan Moneter Bank Sentral	35
2.1.4 Penelitian Terdahulu	43
2.2 Kerangka Pemikiran	52
2.3 Hipotesis Penelitian	62
BAB III METODE PENELITIAN.....	64
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	64
3.2 Jenis dan Sumber Data	66
3.3 Metode Pengumpulan Data	67
3.4 Metode Analisis	68
3.4.1 Hodrick-Prescott Filter	68
3.4.2 Statistik Deskriptif.....	69
3.4.3 Uji Stasioneritas.....	70
3.4.4 Model ARIMA.....	73
3.4.5 <i>Conditional Heteroscedastic Models</i>	76
3.4.6 <i>Generalized Method of Moments</i>	80
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	89
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	89
4.1.1 Gambaran Umum	89
4.1.2 Statistik Deskriptif.....	93

4.2	Estimasi Conditional Mean dan Conditional Variance.....	96
4.2.1	Estimasi <i>Conditional Mean</i> dengan ARIMA	97
4.2.2	Estimasi <i>Conditional Variance</i> dengan ARCH/GARCH	110
4.3	Estimasi GMM	119
4.3.1	Uji Stasioneritas.....	120
4.3.2	Uji Validitas Instrumen.....	121
4.3.3	Uji Hipotesis.....	122
4.3.4	Hasil Estimasi GMM.....	127
4.4	Interpretasi Hasil Penelitian.....	129
4.4.1	Model Aturan Kebijakan Moneter Bank Indonesia.....	129
4.4.2	Preferensi Asimetris Kebijakan Bank Indonesia	144
BAB V	PENUTUP.....	148
5.1	Kesimpulan.....	148
5.2	Keterbatasan Penelitian	150
5.3	Saran	150
	DAFTAR PUSTAKA.....	152
	LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	159

