

DAFTAR ISI

Halaman

DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR TABEL	xv

I. PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang dan Masalah	1
1.2. Tujuan Penelitian.....	3
1.3. Manfaat Penelitian.....	3

II. TINJAUAN PUSTAKA

2.1 Konsep Nilai Tukar Petani (NTP)	4
2.1.1 Pengukuran Nilai Tukar Petani	5
A. Indeks Harga yang Diterima Petani (It)	9
B. Indeks Harga yang Dibayar Petani (Ib)	10
2.2 Data Runtun Waktu (<i>Time Series</i>)	12
2.3 Stasioneritas	12
A. Stasioner dalam ragam	12
B. Stasioner dalam rata-rata	13
2.4 Kointegrasi	14
2.5 Model <i>Vector Autoregressive</i> (VAR)	16
2.5.1 <i>Vector error Correction Model</i> (VECM)	17
2.6 Panjang Lag Optimal	18
2.7 Pengujian Residual	20
2.7.1 Uji Normalitas	20
2.7.2 Uji Stabilitas	21
2.8 <i>Impulse Response Function</i> (IRF)	23

III. METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Waktu dan Tempat Penelitian	25
3.2	Data	25
3.3	Metode Penelitian.....	26

IV. HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1	Identifikasi.....	31
4.1.1	Uji Stasioner	31
4.1.2	Uji Kointegrasi	39
4.2	Estimasi Model	40
4.2.1	Pendugaan Parameter Model VECM (2)	41
4.3	Pengujian Residual	43
4.3.1	Uji Normalitas	43
4.3.2	Uji Stabilitas Model	44
4.4	Analisis Grafik <i>Impulse Response Function</i> (IRF)	44
V.	KESIMPULAN	47

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN