

DAFTAR ISI

	Halaman
SANWACANA	i
DAFTAR ISI	ii
DAFTAR TABEL	iii
DAFTAR GAMBAR	iv
DAFTAR LAMPIRAN	v
I. PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Permasalahan	14
C. Tujuan Penulisan	15
D. Kerangka Pemikiran	15
E. Hipotesis	21
F. Sistematika penulisan	22
II. TINJAUAN PUSTAKA	
A. Nilai Tukar	23
B. Tingkat Suku Bunga	26
C. Inflasi	30
D. Produk Domestic Bruto (PDB)	36
E. Jumlah Uang beredar	38
F. Neraca pembayaran	41
G. Teori Nilai tukar, Tingkat bunga, Inflasi, Jumlah uang beredar, dan Neraca transaksi berjalan	42
H. Rujukan Penelitian (Penelitian-penelitian sebelumnya)	55
III. METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Sumber Data	60
B. Batasan Peubah	60
C. Alat Analisis.....	61
D. Metode Analisis	62
1. ARCH dan GARCH	62
a. Model ARCH	63
b. Model GARCH	64

b.1 Simple GARCH Model With Normally Distributed Residuals	65
b.2 GARCH model with t- distributed Residual	66
b.3 GARCH- M Model	67
b.4 EGARCH Model.....	68
b.5 Stationary GARCH Model.....	69
b.6 I- GARCH- M Model.....	71
2. Uji Stasioner	73
3. Uji Error Correction Mechanism (ECM)	73
4. Uji Asumsi Ordinary Least Square (OLS)	74
a. Uji Asumsi Normalitas.....	74
b. Uji Asumsi Heteroskedastisitas	75
c. Uji Asumsi Otokorelasi.....	77
d. Uji Asumsi Multikolinearitas	78
5. Uji Chow	79
6. Uji Kointegrasi	80
7. Pengujian Hipotesis	81
1. Uji F	81
2. Uji t	81
8. Teknik peramalan.....	83
9. Model ARIMA	83
10. Teknik Proyeksi Jangka Panjang	88
a. The Stepar.....	88
b. The Exponential Smoothing.....	89
c. The Winters	90
d. The AddWinters	90
11. The expand prosedur.....	91

IV. HASIL PERHITUNGAN DAN PEMBAHASAN

A. Uji ARCH dan GARCH	93
1. Uji ARCH.....	93
2. Uji GARCH.....	94
a. Simple GARCH Model	94
b. GARCH model with t-distributed residuals	95
c. GARCH-M Model.....	96
d. EGARCH Model	96
e. I-GARCH Model.....	97
f. Stationary GARCH Model	97
B. Uji Stasioneritas	98
C. Uji ECM.....	99
D. Uji Asumsi Ordinary Least Square (OLS).....	100
1. Uji Asumsi Normalitas	101
a. Metode Grafik	101
b. Kriteria Shapiro- Wilk.....	102
c. Kriteria Kolmogorov- Smirnov	102
d. Kriteria Cramer- Von Misses	103
e. Kriteria Anderson Darling.....	103

2.	Uji Asumsi Heteroskedastisitas	104
a.	Metode Grafik	104
b.	Uji Park.....	105
c.	Uji Glejser	105
d.	Uji White	105
3.	Uji Asumsi Autokorelasi	106
4.	Uji Asumsi Multikolinieritas.....	107
E.	Uji Chow	107
F.	Hasil Perhitungan	108
G.	Pengujian Hipotesis.....	108
1.	Uji F.....	108
2.	Uji t.....	109
H.	Model ARIMA	110
1.	Uji Stasioneritas Data	110
2.	Deteksi Autokorelasi	110
3.	Identifikasi Conditional Mean	111
4.	Estimasi Conditional Mean	113
5.	Proyeksi dengan Model ARIMA.....	114
J.	Proyeksi Jangka Panjang	116
a.	Metode The Exponential Smoothing.....	117
b.	Metode The AddWinters	118
c.	Metode The Winters	119
d.	Metode Stepar.....	120
K.	Pembahasan Hasil	121
L.	Implikasi Hasil Perhitungan	125

V. SIMPULAN DAN SARAN

A.	Simpulan	129
B.	Saran	132

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN