

Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiasi	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel	viii
Daftar Gambar.....	ix
Daftar Lampiran	x
Intisari.....	xi
Abstract.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Motivasi Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	8
1.7 Kontribusi Penelitian	9
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	9
1.9 Sistematika Penulisan.....	9
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 <i>Asset Price Channels</i> -Mishkin (1996)	11
2.1.2 <i>Signaling Channel</i> dan QE.....	12
2.1.3 <i>Portfolio Balance channel</i> dan QE	13
2.1.4 <i>Risk Aversion Channel</i>	13
2.2 Tinjauan Pustaka	14
2.3 Hipotesis Penelitian	19
BAB III METODE PENELITIAN.....	20
3.1 Desain Penelitian	20
3.2 Spesifikasi Model Penelitian	21

3.3	Sumber Data dan Identifikasi Variabel	21
3.3.1	Total aset Federal Reserve Bank.....	22
3.3.2	Jumlah uang beredar oleh The Fed	22
3.3.3	Indeks produksi Indonesia.....	22
3.3.4	Indeks harga konsumen Indonesia	22
3.3.5	Nilai tukar nominal	23
3.3.6	<i>Financial stress index</i> (FSI)	23
3.3.7	Harga saham.....	23
3.4	Teknik Analisis Data	24
3.4.1	Uji akar unit.....	24
3.4.2	Uji seleksi <i>lag</i>	26
3.4.3	Uji stabilitas model	27
3.4.4	Uji <i>Vector Autoregression</i> (VAR)	27
3.4.5	Uji kausalitas Granger.....	28
3.4.6	<i>Impulse Response Function</i>	29
3.4.7	<i>Forecast Error Variance Decomposition</i>	30
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		31
4.1	Deskripsi Data	31
4.2	Hasil Uji Akar Unit	32
4.3	Hasil Uji Seleksi <i>Lag</i> Optimal.....	33
4.4	Hasil Uji Stabilitas Model	34
4.5	Hasil Uji Kausalitas Granger.....	35
4.6	Hasil <i>Impulse Response Function</i>	35
4.7	Hasil <i>Forecast Error Variance Decomposition</i>	37
BAB V KESIMPULAN, KETERBATASAN DAN IMPLIKASI		39
5.1	Kesimpulan.....	39
5.2	Keterbatasan	39
5.3	Implikasi	40
Daftar Pustaka		42
Daftar Lampiran		46