

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
INTISARI.....	v
ABSTRAK.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 . Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	9
1.3. Pertanyaan Penelitian	10
1.4. Tujuan Penelitian.....	10
1.5. Motivasi Penelitian.....	10
1.6. Manfaat Penelitian.....	11
1.7. Kontribusi Penelitian	11
1.8. Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	12
1.9. Sistematika Penulisan.....	12
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1. Studi Kasus Dampak Covid-19 dalam Volatilitas Nilai Tukar Rupiah.....	13
2.2. Landasan Teori	18
2.2.1. Sistem Nilai Tukar	18
2.2.2. Volatilitas dan Hubungan dengan Covid-19.....	19
2.3. Penelitian Terdahulu.....	22
BAB III METODE PENELITIAN.....	26
3.1. Data	26
3.2. Analisis Awal	27
3.3. Metode Penelitian.....	29
3.3.1. Spesifikasi Model Mean Equation.....	30
3.3.2. Uji Lagrange Multiplier (LM)	32
3.3.3. ARCH	33
3.3.4. GARCH	34
3.4. Hipotesis	35
BAB IV PEMBAHASAN.....	36

4.1. Statistik Diskriptif	36
4.2. Model Mean Equation	37
4.3. Uji ARCH-LM	38
4.4. Hasil Estimasi ARCH.....	40
4.5. Hasil Estimasi GARCH.....	41
4.6. Pemilihan Model Terbaik	44
4.7. Perbandingan Antar Komoditas	45
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	48
5.1. Kesimpulan.....	48
5.2. Saran	48
5.2.1. Pengambilan Keputusan atau Kebijakan	48
5.2.2. Keterbatasan Penelitian dan Rekomendasi Penelitian Selanjutnya	49
DAFTAR PUSTAKA	50
LAMPIRAN	56

DAFTAR GAMBAR

Gambar I.1. Kurs Transaksi Rupiah/USD 2001-2022	3
Gambar I.2. Kasus baru Covid-19 Indonesia	6
Gambar II.1. Grafik Nilai Tukar Sebelum Covid-19	14
Gambar II.2. Grafik Nilai Tukar Sesudah Covid-19.....	16

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1. Mitra Dagang Indonesia dari Komoditas 2020	8
Tabel 3.1. Data penelitian	26
Tabel 3.2. Uji Augmented Dicky Fuller Sebelum Covid-19	28
Tabel 3.3. Uji Augmented Dicky Fuller Setelah Covid-19 (uji akar unit).....	29
Tabel 3.4. ACF dan PACF	31
Tabel 3.1. Tabel Statistik Diskriptif Sebelum Covid-19.....	32
Tabel 4.2. Statistik Diskriptif	36
Tabel 4.3. Hasil Uji ARCH LM Sebelum Covid-19.....	38
Tabel 4.4. Hasil Uji ARCH-LM Sesudah Covid-19	39
Tabel 4.5. Hasil Estimasi ARCH	40
Tabel 4.6. Hasil Estimasi GARCH	43
Tabel 4.7. Model terbaik	45

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Analisis AUD	57
Lampiran 2. Analisis CAD.....	60
Lampiran 3. Analisis CHF	63
Lampiran 4. Analisis CNY	66
Lampiran 5. Analisis EUR.....	69
Lampiran 6. Analisis GBP	72
Lampiran 7. Analisis HKD.....	75
Lampiran 8. Analisis PHP.....	78
Lampiran 9. Analisis SGD	81
Lampiran 10. Analisis THB	84
Lampiran 11. Analisis USD	87