

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMBANG	xiii
INTISARI	xvi
ABSTRACT	xvii
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	3
1.3. Batasan Masalah	3
1.4. Tujuan Penelitian	3
1.5. Tinjauan Pustaka	4
1.6. Metode Penelitian	4
1.7. Sistematika Penulisan	5
II DASAR TEORI	7
2.1. Matriks	7
2.1.1. Operasi Matriks	8
2.1.2. Kombinasi Linear	10
2.1.3. Transpose Matriks	11
2.1.4. Trace Matriks	11
2.1.5. Determinan Matriks	12
2.1.6. Invers Matriks	14
2.1.7. <i>Rank</i> Matriks	15
2.1.8. <i>Eigenvalue</i> dan <i>Eigenvector</i> Matriks	17
2.1.9. Vektor Ortogonal dan Ortonormal	19
2.2. Variabel Random	21
2.2.1. Variabel Random Diskrit	22

2.2.2.	Variabel Random Kontinu	23
2.2.3.	Nilai Harapan	24
2.2.4.	Variansi dan Kovariansi	24
2.2.5.	Distribusi Normal	27
2.2.6.	Distribusi Eksponensial	28
2.3.	<i>Maximum Likelihood Estimation</i> (MLE)	28
2.4.	<i>Time Series</i>	29
2.5.	Proses Stokastik	31
2.6.	Stasioneritas	32
2.7.	Uji Akar Unit	34
2.7.1.	Uji <i>Augmented Dickey-Fuller</i> (ADF Test)	34
2.8.	Proses <i>Autoregressive</i> (AR)	36
2.9.	<i>Vector Autoregressive</i> (VAR)	37
2.10.	Uji Lag Optimum	39
2.11.	Kointegrasi	40
2.11.1.	Uji Kointegrasi Johansen	42
2.12.	Uji Kausalitas Granger	45
III	VECTOR ERROR CORRECTION MODEL (VECM)	48
3.1.	Bentuk Umum <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM)	49
3.2.	Estimasi Parameter <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM)	51
3.3.	<i>Impulse Response Function</i> (IRF)	56
3.4.	<i>Variance Decomposition</i>	58
3.5.	Algoritma VECM	59
IV	STUDI KASUS	62
4.1.	Deskripsi Data	62
4.2.	Uji Stasioneritas	63
4.3.	Uji <i>Lag</i> Optimum	64
4.4.	Uji Kointegrasi <i>Johansen</i>	65
4.5.	Estimasi Parameter VECM	66
4.5.1.	Persamaan VECM untuk Variabel Harga Minyak	68
4.5.2.	Persamaan VECM untuk Variabel Inflasi	69
4.5.3.	Persamaan VECM untuk Variabel IHSG	70
4.6.	Uji Kausalitas Granger (<i>Granger Causality Test</i>)	70
4.6.1.	Kausalitas antara Inflasi dan IHSG	71
4.6.2.	Kausalitas antara Harga Minyak dan IHSG	71
4.6.3.	Kausalitas antara Harga Minyak dan Inflasi	72

4.7. <i>Impulse Response Function</i> (IRF)	72
4.7.1. <i>Impulse Response Function</i> Harga Minyak	73
4.7.2. <i>Impulse Response Function</i> IHSG	73
4.7.3. <i>Impulse Response Function</i> Inflasi	74
4.8. <i>Variance Decomposition</i> (VD)	74
4.8.1. <i>Variance Decomposition</i> Harga Minyak	74
4.8.2. <i>Variance Decomposition</i> Inflasi	75
4.8.3. <i>Variance Decomposition</i> IHSG	76
V PENUTUP	78
5.1. Kesimpulan	78
5.2. Saran	79
DAFTAR PUSTAKA	80
A LAMPIRAN SKRIP PROGRAM	83
B DATA PENELITIAN	87
C OUTPUT R	90