

DAFTAR ISI

Judul.....	i
Lembar Pengesahan	ii
Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi... ..	vi
Daftar Tabel	xi
Daftar Gambar.....	xii
Daftar Lampiran.....	xiii
Abstrak.....	xiv
Abstract.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Pertanyaan Penelitian	6
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	7
1.6. Lingkup Penelitian	8

1.7.	Sistematika Penulisan.....	8
BAB II	Landasan Teori	10
2.1.	Landasan Teori.....	10
2.1.1.	Pengertian Uang	10
2.1.1.1.	Pengertian dan Fungsi Uang	10
2.1.1.2.	Teori Keynes	12
2.1.2.	Perdagangan Internasional	13
2.1.2.1.	Pengertian Perdagangan Internasional	13
2.1.2.2.	Pengertian Ekspor	16
2.1.2.3.	Pengertian Impor	17
2.1.3.	Pengertian Volatilitas	18
2.1.4.	Mitra Dagang Indonesia.....	18
2.1.4.1.	Eropa	18
2.1.4.2.	Amerika Serikat	19
2.1.4.3.	Jepang.....	20
2.1.5.	Pengertian Valuta Asing	21
2.1.6.	Pengertian Investasi	23
2.1.6.1.	Deposito	23
2.1.6.2.	Obligasi	24

2.1.6.3.	Reksadana	25
2.1.6.4.	Saham.....	26
2.1.6.5.	Mata Uang Asing	26
2.2.	Metode ARCH/GARCH	27
2.3.	Kajian Penelitian Terdahulu.....	29
2.4.	Kerangka Pemikiran.....	33
2.5.	Pengembangan Hipotesis	35
BAB III	Metode Penelitian.....	37
3.1.	Pendekatan Penelitian	37
3.2.	Metoda Pengumpulan Data.....	37
3.3.	Data	38
3.4.	Instrumen Penelitian.....	38
3.4.1.	Variabel	38
3.5.	Prosedur Penelitian.....	39
3.5.1.	Melakukan Analisis Data Nilai Tukar.....	39
3.5.2.	Melakukan Uji Stasioneritas	40
3.5.3.	Membuat Model Arima Terbaik	41
3.5.4.	Uji Efek ARCH	42
3.5.5.	Estimasi GARCH.....	43

3.5.6.	Pengujian Efek ARCH	43
3.5.7.	Pengujian Normalitas	44
3.5.8.	Pengujian Keacakan Residual	44
3.6.	Model Penelitian	44
BAB IV	Hasil dan Pembahasan	47
4.1.	Deskripsi Statistik	47
4.1.1.	Pengukuran Imbal Hasil Nilai Tukar Mata Uang	47
4.1.2.	Uji Normalitas	48
4.1.3.	Uji Keberadaan <i>Outlier</i>	50
4.1.4.	Analisa Deskriptif	52
4.1.5.	Uji Stasioneritas Data.....	52
4.1.5.1.	Uji Stasioneritas Dengan Augmented Dickey Fuller (ADF)	53
4.1.5.2.	Uji ACF dan PACF	54
4.2.	Pendugaan ARIMA	57
4.2.1.	Uji Efek ARCH	58
4.2.2.	Estimasi GARCH	59
4.3.	Pengujian Hasil Analisa	61
4.3.1.	Uji Efek ARCH LM	61
4.3.2.	Uji Normalitas	63

4.3.3.	Pengujian Keacakan Residual	64
BAB V	Hasil dan Kesimpulan.....	67
5.1.	Simpulan	67
5.2.	Saran.....	71
	Daftar Pustaka	73