

Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Persetujuan.....	iii
Halaman Pernyataan Keaslian Karya Tulis.....	iv
Kata Pengantar	v
Halaman Persembahan	vi
Daftar Isi.....	viii
Daftar Gambar.....	xi
Daftar Lampiran	xii
Intisari	xiv
Abstract	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Pertanyaan Penelitian	8
1.4. Tujuan Penelitian.....	8
1.5. Manfaat Penelitian.....	8
1.6. Kontribusi Penelitian	8
1.7. Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	9
1.8. Sistematika Penulisan.....	9
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1. Landasan Teori	10
2.1.1. Teori pendekatan aset.....	10



2.1.2. Keseimbangan pasar uang dan tingkat suku bunga.....	13
2.1.3. Uang, tingkat harga dan nilai tukar dalam jangka pendek.....	15
2.2. Tinjauan Pustaka	19
2.3. Hipotesis Penelitian	26
BAB III METODE PENELITIAN	27
3.1. Desain Penelitian	27
3.2. Spesifikasi Model Penelitian	27
3.3. Sumber Data dan Identifikasi Variabel	28
3.3.1. <i>Effective Federal Fund Rate (FFR)</i>	28
3.3.2. Indeks produksi (IP) Amerika Serikat.....	29
3.3.3. Indeks harga konsumen Amerika Serikat	29
3.3.4. Nilai tukar riil.....	29
3.3.5. Jakarta Interbank Offered Rate (JIBOR).....	30
3.3.6. <i>Non-borrowed reserve ratio</i>	30
3.3.7. Indeks produksi Indonesia.....	30
3.4. Teknik Analisis Data	31
3.4.1. Uji akar unit	32
3.4.2. Uji seleksi lag.....	34
3.4.3. Uji stabilitas model	36
3.4.4. Uji kausalitas Granger	36
3.4.5. Uji <i>Vector Autoregressive (VAR)</i>	37
3.4.6. <i>Impulse Response Function</i>	37
3.4.7. <i>Forecast Error Variance Decomposition</i>	38
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	39
4.1. Deskripsi Data.....	39
4.2. Uji Akar Unit.....	42
4.3. Uji Seleksi <i>Lag</i> Optimal	46
4.4. Uji Stabilitas Model.....	48
4.5. Hasil Uji Kausalitas Granger.....	49
4.6. Hasil <i>Impulse Response Function VAR</i>	50
4.7. Uji <i>Forecast Error Variance Decomposition</i>	53
BAB V KESIMPULAN	57
5.1. Kesimpulan.....	57
5.2. Saran	58
Daftar Pustaka	59
Daftar Lampiran	62