

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
PERNYATAAN	xii
INTISARI	xiii
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Tujuan Penelitian	5
1.5. Manfaat Penelitian	5
BAB II	6
TINJAUAN PUSTAKA	6
BAB III	8
LANDASAN TEORI	8
3.1. Model Persamaan Regresi	8
3.1.1. Model Regresi Linier Sederhana	8
3.1.2. Model Regresi Linier Berganda	9
3.2. Time Series	10
3.3. Stasioneritas	12
3.4. Penentuan Lag Optimum	18
3.5. Nilai Eigen dan Vektor Eigen	20
3.6. Estimasi Parameter	23
3.7. Pertanyaan Penelitian	26

BAB IV	27
METODE PENELITIAN	27
4.1. Identifikasi Masalah	27
4.2. Objek Penelitian	27
4.3. Metode Pengumpulan dan Sumber Data	28
4.4. Analisis Data	28
4.5. Diagram Alir Penelitian	32
BAB V	34
HASIL DAN PEMBAHASAN	34
5.1. Vector Autoregressive (VAR)	34
5.2. Model Vector Autoregressive (VAR)	35
5.3. Model <i>Vector Autoregressive</i> (VAR) pada Interaksi Kebijakan Fiskal dan Moneter di Indonesia	38
5.4. Penerapan Model Vector Autoregressive (VAR)	40
5.4.1. Stasioner Data	40
5.4.2. Uji Kointegrasi	42
5.4.3. Penentuan Lag Optimal	43
5.4.4. Pengujian Kausalitas Granger	44
5.4.5. Analisis Model VAR	47
5.5. Uji Sensitivitas	49
5.5.1. Impulse Response	50
5.5.2. Variance Decomposition	52
BAB VI	55
KESIMPULAN DAN PENUTUP	55
6.1. Kesimpulan	55
6.2. Saran	57
DAFTAR PUSTAKA	58

