

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING</b> .....	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>v</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xi</b>
<b>PERNYATAAN</b> .....	<b>xii</b>
<b>INTISARI</b> .....	<b>xiii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>xiv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	2
1.3 Batasan Masalah .....	3
1.4 Tujuan Penelitian .....	3
1.5 Manfaat Penelitian .....	3
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b> .....	<b>5</b>
2.1 Penelitian Terdahulu .....	5
<b>BAB III LANDASAN TEORI</b> .....	<b>6</b>
3.1 Pengertian Indeks Harga Saham Gabungan.....	6
3.2 Pengertian Inflasi .....	6
3.3 Pengertian Nilai Tukar (Kurs) .....	7
3.4 VAR ( <i>Vector Autoregression</i> ) .....	7
3.5 Stasioneritas .....	10
3.6 Penentuan Lag Optimal .....	11
3.7 Uji Kausalitas Granger.....	12
3.8 Uji Kointegrasi.....	14
3.9 Analisis Impulse Responses Function .....	14
3.10 Analisis Variance Decomption .....	15

<b>BAB IV METODOLOGI PENELITIAN.....</b>	<b>16</b>
4.1 Populasi dan Sampel Penelitian.....	16
4.2 Variabel Penelitian.....	16
4.3 Metode Pengumpulan Data.....	16
4.4 Metode Analisis Data.....	16
4.5 Diagram Alir .....	17
<b>BAB V PEMBAHASAN.....</b>	<b>19</b>
5.1 Uji Stasioner .....	19
5.2 Penentuan Lag Optimum .....	19
5.3 Uji Stabilitas VAR.....	20
5.4 Uji Kointegrasi.....	20
5.5 Uji Kausalitas Granger.....	21
5.6 Estimasi Model VECM.....	22
5.7 Analisis Impulse Response Function (IRF) .....	23
5.8 Analisis Variance Decompotion .....	25
<b>BAB VI PENUTUP.....</b>	<b>28</b>
6.1 Kesimpulan .....	28
6.2 Saran .....	29
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	
<b>LAMPIRAN</b>	

## DAFTAR TABEL

Nomor	Judul	Halaman
5.1	Tabel hasil Uji Stasioner	19
5.2	Tabel hasil Uji Stasioner <i>first difference</i>	19
5.3	Tabel hasil Uji Lag Optimum	20
5.4	Tabel hasil Uji Stabilitas VAR	20
5.5	Tabel hasil Uji Kointegrasi	21
5.6	Tabel hasil Uji Kasualitas Granger	22

## **DAFTAR GAMBAR**

Nomor	Judul	Halaman
5.1	Plot impulse response function	23
5.2	Variance Decomposition dari Variabel IHSG	25
5.3	Variance Decomposition dari Variabel Kurs	26
5.4	Variance Decomposition dari Variabel Tingkat Inflasi	26

## DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Judul
1	<b>Lampiran 1</b> Data IHSG, Kurs, dan Inflasi
2	<b>Lampiran 2</b> Output Uji Stasioner pada Level
3	<b>Lampiran 3</b> Output Uji Stasioner pada First Difference
4	<b>Lampiran 4</b> Output Uji Lag Optimal
5	<b>Lampiran 5</b> Output Uji Stabilitas VAR
6	<b>Lampiran 6</b> Output Uji Kointegrasi
7	<b>Lampiran 7</b> Output Uji Kausalitas Granger
8	<b>Lampiran 8</b> Output Model VECM
9	<b>Lampiran 9</b> Output Impulse Response Function (IRF)
10	<b>Lampiran 10</b> Output Variance Decomposition