

BAB IV

METODOLOGI PENELITIAN

4.1 Populasi dan Sampel Penelitian

Populasi dalam penelitian ini adalah data Inflasi, Kurs mata uang dan IHSG (Indeks Harga Saham Gabungan). Sementara sampel yang diambil adalah data tersebut selama 120 bulan, dari bulan Juni 2009 sampai dengan Mei 2019.

4.2 Variabel Penelitian

Variabel yang digunakan pada penelitian ini adalah variabel inflasi, kurs dan IHSG. Pemilihan variabel ini didasarkan dari tujuan penelitian ini, yaitu untuk mengetahui bagaimana pengaruh inflasi dan kurs terhadap IHSG.

4.3 Metode Pengumpulan Data

Dalam penelitian ini data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh dari *website resmi yahoo finance* (<https://finance.yahoo.com/>) dan *website resmi Bank Indonesia* (<https://www.bi.go.id/>).

4.4 Metode Analisis Data

Langkah-langkah analisis data pada penelitian ini adalah sebagai berikut:

1. Melakukan Uji stasioner,
2. Pemilihan Panjang lag Model
3. Melakukan Uji Stabilitas Var
4. Melakukan uji kointegrasi
5. Melakukan Uji Kasualitas Granger
6. Menentukan Model VECM
7. Pengkajian *Impulse Response Function*

8. Pengkajian *Vector Decompotion*

4.5 Diagram Alir



Gambar 4.1 Diagram Alir Vector Autoregression

Proses diagram alir itu sendiri dimulai dengan melakukan uji stasioner jika data stasioner maka akan dilanjut keanalisis selanjutnya, jika tidak stasioner perlu dilakukan proses *differencing* supaya data stasioner. Karena data telah stasioner pada *first difrence* maka arah analisis yang akan dilakukan adalah analisis VARD

atau VECM. Langkah selanjutnya yaitu penentuan lag optimum. setelah mendapatkan lag optimumnya kemudian dilanjutkan Uji stabilitas VAR. selanjutnya melakukan Uji Kointegrasi, dimana jika data terjadi kointegrasi maka analisis yang digunakan yaitu analisis VECM, namun jika tidak terjadi kointegrasi maka analisis yang digunakan yaitu analisis VARD. Langkah selanjutnya yaitu melakukan Uji kausalitas Granger. Langkah terakhir pada penelitian ini adalah melakukan analisis IRF dan VD.