

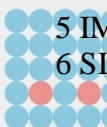


DAFTAR ISI

DAFTAR ISI	1
DAFTAR GAMBAR	
DAFTAR TABEL	
1 PENDAHULUAN	1
Latar Belakang	1
Rumusan Masalah	3
Tujuan Penelitian	3
Manfaat Penelitian	3
2 TINJAUAN PUSTAKA	4
Ekonometrika Deret Waktu	4
Karakteristik Data Deret waktu	4
Valuta Asing	5
Pasar Valuta Asing	5
Pelaku Pasar Valas	6
Definisi Nilai Tukar	6
Volatilitas	8
<i>Contagion dan Volatilitas Spillover</i>	9
Model Volatilitas	10
Varian-varian Model ARCH dan GARCH	11
Model <i>Vector Autoregressive</i> (VAR)	12
Bentuk Model VAR	13
Analisis Dalam Model VAR	13
Penelitian Terdahulu	15
Kerangka Alur Pemikiran	22
3 METODELOGI PENELITIAN	23
Jenis dan Sumber Data	23
Metode Analisis Data	23
Tahap-Tahap pengolahan data	23
4 HASIL DAN PEMBAHASAN	26
Uji Secara Grafis	26
Pengujian Pra-estimasi	28
Volatilitas Nilai Tukar	29
Analisis Volatilitas Masing-Masing Nilai Tukar	30
Analisis <i>Impulse Response</i> dan <i>Variance Decomposition</i>	32
Pengujian Praestimasi	32
Analisis <i>Impulse Response Function</i> (IRF)	35
Analisis <i>Forecast Error Variance Decomposition</i> (FEVD)	36
5 IMPLIKASI MANAJERIAL	36
6 SIMPULAN DAN SARAN	38
Simpulan	38
Saran	38
DAFTAR PUSTAKA	40
LAMPIRAN	42
RIWAYAT HIDUP	60

© Hak cipta milik IPB, tahun 2015

Hak cipta dilindungi Undang-Undang



Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

IPB-IPB

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang menggunakan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



DAFTAR GAMBAR

1	Perbandingan kerawanan eksternal dan kerapuhan nilai tukar sejumlah negara	1
2	Wabah depresiasi akibat krisis global pada tanggal 11 November 2008	2
3	Mata uang yang mengalami depresiasi mencolok di Asia Pasifik pada tanggal 28 November 2008	2
4	Bagan alur kerangka pemikiran	22
5	Bagan kerangka alur metodologi	25
6	Perbandingan pergerakan nilai tukar mata uang utama dunia terhadap nilai tukar rupiah tahun 2010-2014	27
6	Perbandingan volatilitas masing-masing nilai tukar	31
7	<i>Impulse response</i> nilai tukar IDR/USD	34
8	Dekomposisi keragaman nilai tukar IDR/USD	35

DAFTAR TABEL

1	Rangkuman penelitian terdahulu	17
2	Uji akar unit (<i>Level</i>)	28
3	Uji efek ARCH	29
4	Pemilihan model nilai tukar terbaik	29
5	Uji stasioneritas data residual	32
6	Uji kausalitas Granger untuk residul masing-masing mata uang	32
7	Penentuan <i>lag</i> optimal untuk variabel	33
8	Pangsa (%) GDP dunia dari sejumlah perekonomian terbesar	36

DAFTAR LAMPIRAN

1	Analisis EGARCH	44
2	Uji efek ARCH	47
3	.Uji volatilitas.	49
4	Analisis VAR	57
5	Uji <i>ordering</i>	60

