

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN PUBLIKASI.....	iii
RIWAYAT HIDUP	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah	6
1.3 Batasan Masalah.....	7
1.4 Rumusan Masalah	7
1.5 Tujuan Penelitian.....	7
1.6 Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Analisis <i>Time series</i>	9
2.2 Stasioneritas Data	10
2.3 Penentuan Panjang <i>Lag</i> Optimal.....	13
2.4 Vector Autoregressive (VAR).....	14
2.5 Stabilitas Model VAR.....	17
2.6 Uji Kausalitas <i>Granger</i>	18
2.7 Uji Kointegrasi	20
2.8 <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM).....	21
2.9 Impulse Response Function (IRF)	22
2.10 <i>Variance</i> Decomposition (VD).....	24
2.11 <i>Mean Absolute Persentase Error</i> (MAPE).....	26
2.12 Indeks Harga Konsumen (IHK)	27
2.13 Inflasi	29

2.14	Python	30
2.15	Langkah-Langkah Penerapan Analisis Kointegrasi dan <i>Vector Error Correction Model</i>	30
BAB III METODE PENELITIAN		32
3.1	Lokasi dan Waktu Penelitian	32
3.2	Jenis Penelitian dan Sumber Data	32
3.3	Variabel Penelitian.....	32
3.4	Prosedur Penelitian.....	32
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		35
4.1	Hasil Penelitian.....	35
4.1.1	Deskripsi Data Penelitian.....	35
4.1.2	Stasioneritas Data	38
4.1.3	Penentuan Panjang <i>Lag</i> Optimal.....	40
4.1.4	Stabilitas VAR	41
4.1.5	Uji Kausalitas <i>Granger</i>	42
4.1.6	Uji Kointegrasi.....	43
4.1.7	Estimasi <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM).....	44
4.1.8	Analisis <i>Impulse Response Function</i> (IRF)	47
4.1.9	Analisis <i>Variance Decomposition</i> (VD).....	52
4.1.10	Akurasi Model	54
4.1.11	Peramalan.....	55
4.2	Pembahasan	55
BAB V PENUTUP.....		59
5.1	Kesimpulan.....	59
5.2	Saran.....	60
DAFTAR PUSTAKA.....		61
LAMPIRAN.....		64