

BAB V

PENUTUP

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan analisis dapat disimpulkan bahwa:

1. Bentuk model *distributed lag* menggunakan metode koyck adalah sebagai berikut
$$\hat{Y}_t = 7958 + 0,0002X_t + 0,000177X_{t-1} + 0,000157X_{t-2} + 0,000139X_{t-3} + 0,0000123X_{t-4}$$

Model *distributed lag* dengan menggunakan metode koyck menunjukkan bahwa, koefisien dari Y_{t-1} bernilai positif yaitu sebesar 0.855. Nilai 0.855 berarti bahwa apabila jumlah uang beredar naik sebesar 1 satuan maka nilai tukar rupiah akan naik sebesar 0,855 satuan.

2. Bentuk model *distributed lag* menggunakan metode Almon adalah sebagai berikut

$$\hat{Y}_t = 6765,9 - 0,0106X_t - 0,0001X_{t-1} - 0,1454X_{t-2} - 0,0037X_{t-3} - 0,0178X_{t-4}$$

Dilihat dari model *distributed lag* menggunakan metode Almon X_t bertanda negatif berarti, hubungan antara nilai tukar rupiah sekarang dengan jumlah uang beredar sekarang berlawanan arah atau negatif. Semakin besar jumlah uang beredar sekarang maka semakin kecil nilai tukar rupiah sekarang.

3. Berdasarkan hasil pemilihan model terbaik menggunakan nilai SIC, model dengan nilai SIC yang lebih rendah adalah model koyck yang dapat digunakan untuk menentukan model *distributed lag* pada kasus pengaruh jumlah uang beredar terhadap nilai tukar rupiah.

5.2 Saran

1. Peneliti selanjutnya dapat menggunakan model *distribusi lag* dan model *autoregressive* dengan menggunakan metode koyck dan metode almon, dalam kasus pengaruh jumlah uang beredar terhadap nilai tukar rupiah.
2. Pada penelitian selanjutnya dapat menggunakan metode lain untuk menentukan model *distributed lag* pada pengaruh jumlah uang beredar terhadap nilai tukar rupiah seperti, metode Jorgenson atau Pascal.

DAFTAR PUSTAKA

- Abimanyu, Y. 2004. *Memahami Kurs Valuta Asing*. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Aqibah, M., Suciptawati, N., Sumarjaya. I. 2020. *Model Dinamis Autoregressive Distributed Lag* (Studi Kasus: Pengaruh Kurs Dolar Amerika Dan Inflasi Terhadap Harga Saham Tahun 2014-2018). *Jurnal Matematika* Vol. 9, No. 4. 240-250.
- Desrini. 2004. Pengaruh kinerja keuangan, nilai tukar rupiah, tingkat Bunga Deposito dan tingkat inflasi terhadap harga saham sektor Industri di BEJ. Skripsi Universitas Riau.
- Firdaus., Ananti. 2011. *Pengantar Teori Moneter*. Bandung: Alfabeta.
- Gujarati, D.N. 1995. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: Erlangga.
- Gujarati, D.N. 1978. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: Erlangga.
- Gujarati, D.N. 2013. *Basic Econometrics*. New York: McGraw- Hill Education.
- Gujarati, D.N. 1988. *Basic Econometrics. (2nd Edition)*. McGraw-Hill Book Co. Singapore.
- Gujarati, D.N., Porter, D.C. 2010. *Basic Econometrics Buku I: Dasar-Dasar Ekonometrika. (Edisi ke-5)*. Jakarta: Salemba Empat.
- Gujarati, D.N., Porter, D.C. 2012. *Basic Econometrics Buku II: Dasar-Dasar Ekonometrika. (Edisi ke-5)*. Jakarta: Salemba Empat.
- Jannah, Z. 2019. Penerapan Perbandingan *Distributed Lag* Untuk Memodelkan Nilai Ekspor Indonesia Terhadap Jepang Dengan Menggunakan Transformasi Koyck Dan Almon. Malang. Skripsi Jurusan Statistika Fakultas Matematika Dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Brawijaya Malang.
- Jatiningrum, N. 2008. *Model Dinamis: Autoregressive dan Distribusi Lag*. Yogyakarta. Skripsi Program Studi Matematika Jurusan Pendidikan Matematika FMIPA Universitas Negeri Yogyakarta.

- Kusumaningrum, D., Sugiyarto, S. 2018, *Comparison the Error Rate of Autoregressive Distributed Lag (ARDL) and Vector Autoregressive (VAR) (Case study: Forecast of Export Quantities in DIY)*. *Eksakta*. Vol. 18, No. 2. 167-177.
- Landa, T. N. 2017. Pengaruh jumlah uang beredar dan suku bunga BI terhadap Kurs rupiah di Indonesia Periode 2005-2014. *JOM Fekon*, Vol. 4, No.1. 214-225.
- Muchlas, Z. 2015. Faktor-faktor yang mempengaruhi kurs rupiah terhadap dolar Amerika pasca krisis (2000-2010). *Jurnal JIBEKA* Vol 9, No.1. 76-86.
- Mustika, D., Setiawan. 2014. Peramalan Penjualan Sepeda Motor di Jawa Timur dengan Menggunakan Model Dinamis. *Jurnal Sains dan Seni Pomits*. Vol.3, No.2. 224-229.
- Nurahman, M.C., Sri, W., Desi.Y. 2016, 'Model Dinamis *Autoregressive* dan Distribusi *Lag* Pengaruh Kurs Dollar Amerika terhadap Prooduk Domestik Regional Bruto (PDRB), *Eksponensial*. Vol.7, No.2. 139-146.
- Pradana, W.A., Rita, R., Sugito. 2016. Analisis Pengaruh Kurs Rupiah Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Menggunakan *Distributed Lag Model*. *Gaussian*. Vol.5, No.1. 221-227.
- Pratami, F.R., Sudarno., Ispriyanti, D. 2016. Peramalan Dinamis Produksi Padi di Jawa Tengah menggunakan metode *Koyck* dan *Almon*. *Gaussian*. Vol.5, No.1. 91-97.
- Pratisto, A. 2004. *Cara Mudah Mengatasi Masalah Statistik dan Rancangan Percobaan dengan SPSS 12*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Razali, N.M., Wah, Y.B. 2011. *Power Comparison Of Shapiro-wilk, KolmogorovSmirnov, Lillifors and Anderson-Darling Tests*. *Journal Of Statistical Modelling and Analytic*. Vol.2, No.1. 21-33.
- Rangkuti, A. 2007. Kombinasi Penaksiran Model Lag Terdistribusi dengan Ekspektasi Adaptif dan Penyesuaian Parsial. *Jurnal Matematika*. Makassar: Universitas Hasanudin.
- Rohmad, H., Supriyanto 2015. *Pengantar Statistika*. Yogyakarta: Kalimedia.
- Salvatore, D. 1997. *Ekonomi Internasional*. Jakarta: Erlangga.
- Suharyadi., Purwanto S.K., 2004. *Statistika: Untuk Ekonomi dan Keuangan Modern*. Jakarta: Salemba Empat.
- Sukirno, S. 2012. *Makro Ekonomi Teori Pengantar*. Jakarta: Raja Grafindo Persada

Supranto, J. 2008. *Statistika Teori dan Aplikasi*. jilid 1. Jakarta: Erlangga.

Supranto, J. 2009. *Statistika Teori dan Aplikasi*. jilid 2. Jakarta: Erlangga.

Supranto, J. 1995. *Ekonometrik*. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.