

Damodar N. Gujarati | Dawn C. Porter

Dasar-dasar Ekonometrika

EDISI 5 | BUKU 2

Basic Econometrics



**Penerbit
Salemba Empat**



>> Buku Asli Berstiker Hologram

Daftar Isi Ringkas

Kata Pengantar	xv
Ucapan Terima Kasih	xix
Bagian 2 Melepaskan Asumsi-asumsi Model Klasik	1
Bab 12 Autokorelasi: Apa yang Terjadi jika Faktor-faktor Kesalahan Saling Berkorelasi?	7
Bab 13 Pemodelan Ekonometrika: Spesifikasi Model dan Pengujian Diagnostik	77
Bagian 3 Topik-topik dalam Ekonometrika	149
Bab 14 Model Regresi Nonlinear	151
Bab 15 Model Regresi Respons Kualitatif	171
Bab 16 Model Regresi Data Panel	235
Bab 17 Model Ekonometrika Dinamis: Model Autoregressive dan Model Distributed-Lag	269
Bagian 4 Model Persamaan Simultan dan Ekonometrika Time Series	337
Bab 18 Model Persamaan Simultan	339
Bab 19 Masalah Identifikasi	359
Bab 20 Metode Persamaan Simultan	389
Bab 21 Ekonometrika Time Series: Konsep Dasar	423
Bab 22 Ekonometrika Time Series: Peramalan	471
Sebuah Tinjauan Beberapa Konsep Dasar Statistik	L-1
Dasar-dasar Aljabar Matriks	L-51
Pendekatan Matriks untuk Model Regresi Linear	L-67
Tabel-tabel Statistik	L-103
Output Komputer dari EViews, MINITAB, Excel, dan STATA	L-121
Data Ekonomi pada World Wide Web*	L-129
Referensi	R-1
Indeks Nama	IN-1
Indeks	I-1

Daftar Isi

Kata Pengantar	xv
-----------------------	-----------

Ucapan Terima Kasih	xix
----------------------------	------------

Bagian 2 Melepaskan Asumsi-asumsi Model Klasik 1

Bab 12 Autokorelasi: Apa yang Terjadi jika Faktor-faktor Kesalahan Saling Berkorelasi? 7

12.1 Sifat Alamiah dari Problem	8
12.2 Estimasi OLS pada Keberadaan Autokorelasi	16
12.3 Estimator BLUE pada Keberadaan Autokorelasi	19
12.4 Konsekuensi-konsekuensi Penggunaan OLS pada Keberadaan Autokorelasi	20
12.5 Hubungan antara Upah dan Produktivitas pada Sektor Bisnis Amerika Serikat, 1960–2005	27
12.6 Mendeteksi Autokorelasi	29
12.7 Apa yang Harus Dilakukan Ketika Menemukan Autokorelasi: Langkah-langkah Perbaikan	43
12.8 Model Mis-Spesifikasi versus Autokorelasi Murni	43
12.9 Koreksi untuk Autokorelasi (Murni): Metode Generalized Least-Square	44
12.10 Metode Newey–West untuk Memperbaiki Standard Error OLS	52
12.11 OLS versus FGLS dan HAC	53
12.12 Aspek-aspek Tambahan dari Autokorelasi	53
12.13 Sebuah Contoh yang Menyimpulkan	55
Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	57
LATIHAN-LATIHAN	59

Lampiran 12A 74

12A.1 Pembuktian bahwa Faktor Kesalahan V_t pada Persamaan (12.1.11) Berautokorelasi	74
12A.2 Pembuktian Persamaan (12.2.3), (12.2.4), dan (12.2.5)	74

Bab 13 Pemodelan Ekonometrika: Spesifikasi Model dan Pengujian Diagnostik 77

13.1 Kriteria Pemilihan Model	78
13.2 Jenis-jenis Kesalahan Spesifikasi	79
13.3 Konsekuensi-konsekuensi dari Bias Spesifikasi Model	81

13.4	Pengujian-pengujian Bias Spesifikasi	87
13.5	Kesalahan-kesalahan Pengukuran	97
13.6	Spesifikasi Faktor Kesalahan Stokastik yang Salah	102
13.7	Model-model Nested versus Non-Nested	103
13.8	Pengujian Hipotesis-hipotesis Non-Nested	104
13.9	Kriteria Pemilihan Model	111
13.10	Topik-topik Tambahan dalam Pemodelan Ekonometrika	115
13.11	Contoh-contoh yang Menyimpulkan	120
13.12	Kesalahan Nonnormal dan Regresor Stokastik	132
13.13	Sebuah Kata untuk para Praktisi	134
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	135
	LATIHAN-LATIHAN	136
Lampiran 13A		144
13A.1	Pembuktian bahwa $E(b_{12}) = \beta_2 + \beta_3 b_{32}$ [Persamaan (13.3.3)]	144
13A.2	Konsekuensi dari Memasukkan sebuah Variabel yang Tidak Relevan: Sifat Ketidakbiasan	145
13A.3	Pembuktian Persamaan (13.5.10)	145
13A.4	Pembuktian Persamaan (13.6.2)	147

Bagian 3 Topik-topik dalam Ekonometrika 149

Bab 14	Model Regresi Nonlinear	151
14.1	Model-model Regresi yang pada Hakikatnya Linear dan Nonlinear	151
14.2	Estimasi Model Regresi Linear dan Nonlinear	153
14.3	Estimasi Model Regresi Nonlinear: Metode Trial-and-Error (The Trial-and-Error Method)	154
14.4	Pendekatan-pendekatan untuk Estimasi Model Regresi Nonlinear	156
14.5	Contoh Ilustratif	158
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	163
	LATIHAN-LATIHAN	164
Lampiran 14A		166
14A.1	Turunan dari Persamaan (14.2.4) dan (14.2.5)	166
14A.2	Metode Linearisasi	167
14A.3	Taksiran Linear dari Fungsi Eksponensial pada Persamaan (14.2.2)	168
Bab 15	Model Regresi Respons Kualitatif	171
15.1	Sifat dari Model Respons Kualitatif	171
15.2	Model Probabilitas Linear	174

15.3	Penggunaan LPM	181
15.4	Alternatif-alternatif bagi LPM	185
15.5	Model Logit	187
15.6	Estimasi Model Logit	190
15.7	Model Logit Kelompok (Grouped Logit–Glogit): Contoh Numerik	193
15.8	Model Logit untuk Data Individual atau Bukan Kelompok	197
15.9	Model Probit	202
15.10	Model Logit dan Probit	209
15.11	Model Tobit	212
15.12	Memodelkan Data Hitung: Model Regresi Poisson	215
15.13	Topik-topik Lanjutan dari Model Regresi Respons Kualitatif	219
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	221
	LATIHAN-LATIHAN	222
Lampiran 15A		231
15A.1	Estimasi Maximum Likelihood untuk Model Logit dan Probit untuk Data Individual (Tidak Berkelompok)	231
Bab 16	Model Regresi Data Panel	235
16.1	Mengapa Data Panel?	237
16.2	Data Panel: Sebuah Contoh Ilustratif	238
16.3	Regresi OLS Pooled atau Model Koefisien Konstan	239
16.4	Model Fixed Effects Least Square Dummy Variable (LSDV)	241
16.5	Estimator Fixed-Effect Within-Group (WG)	246
16.6	Model Random Effects	249
16.7	Sifat-sifat dari Berbagai Estimator	254
16.8	Model Fixed Effects Dibandingkan dengan Random Effects: Beberapa Pedoman	254
16.9	Regresi Data Panel: Beberapa Komentar Kesimpulan	256
16.10	Beberapa Contoh Ilustratif	256
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	262
	LATIHAN-LATIHAN	263
Bab 17	Model Ekonometrika Dinamis: Model Autoregressive dan Model Distributed-Lag	269
17.1	Peran “Waktu” atau “Lag” dalam Ekonomi	270
17.2	Alasan yang Mendasari Selang Waktu (Lag)	275
17.3	Estimasi dari Model Distributed-Lag	276
17.4	Pendekatan Koyck terhadap Model Distributed-Lag	278

17.5	Rasionalisasi dari Koyck Model: Model Ekspektasi Adaptif	284
17.6.	Rasionalisasi yang lain dari Model Koyck: Model Stock Adjustment atau Partial Adjustment	287
17.7	Kombinasi dari Model Ekspektasi Adaptif dan Penyesuaian Parsial	290
17.8	Estimasi dari Model Autoregressive	291
17.9	Metode Variabel Instrumental (IV)	293
17.10	Mendeteksi Autokorelasi dalam Model Autoregressive: Durbin h Test	294
17.11	Contoh Numerik: Permintaan terhadap Uang di Kanada, 1979-I sampai 1988-IV	297
17.12	Contoh Ilustratif	300
17.13	Pendekatan Almon pada Model Distributed-Lag: Almond atau Polinomial Distributed Lag (PDL)	304
17.14	Hubungan Sebab Akibat dalam Ilmu Ekonomi: Tes Kausalitas Granger (Granger Causality Tes)	313
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	321
	LATIHAN-LATIHAN	322
	Lampiran 17A	334
	17A.1 Uji Sargant untuk Validitas Instrumen	334

Bagian 4	Model Persamaan Simultan dan Ekonometrika Time Series	337
-----------------	--	------------

Bab 18	Model Persamaan Simultan	339
18.1	Sifat dari Model Persamaan Simultan	339
18.2	Contoh-contoh Model Persamaan Simultan	340
18.3	Bias Persamaan Simultan: Ketidakkonsistenan Penduga OLS	347
18.4	Bias Persamaan Simultan: Contoh Numerik	350
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	352
	LATIHAN-LATIHAN	353
Bab 19	Masalah Identifikasi	359
19.1	Notasi dan Definisi	359
19.2	Permasalahan Identifikasi	363
19.3	Ketentuan Identifikasi	372
19.4	Sebuah Uji Kesimultanan	378
19.5	Uji Eksogenitas	381
	Penjelasan Singkat dan Kesimpulan	382
	LATIHAN-LATIHAN	383