

# EKONOMETRIKA

esensi dan aplikasi dengan  
menggunakan EViews



**Moch. Doddy Ariefianto**

Kata Pengantar **vi**

Tentang Penulis **viii**

Daftar Isi **ix**

Definisi Ekonometrika **1**

Beberapa Terminologi **2**

Tentang Data **4**

Tahapan Empiris **5**

Representasi Regresi Sederhana **8**

Estimasi Model: Ordinary Least Squares **9**

Pengujian Hipotesis **13**

Kelaikan Suai (Goodness of Fit) **15**

Representasi **17**

Estimasi dan Interpretasi **18**

Pengujian Hipotesis **20**

Kelaikan Suai (Goodness of Fit) **24**

Pendahuluan **26**

Autokorelasi **26**

Penyebab Autokorelasi **27**

Implikasi Autokorelasi **28**

Teknik Deteksi **29**

Prosedur Koreksi **31**

Heterokedastisitas **37**

Penyebab Heterokedastisitas **38**

Implikasi Heterokedastisitas **39**

Teknik Deteksi **40**

Prosedur Koreksi **42**

Konsep Multikolinearitas **51**

Penyebab Multikolinearitas **52**  
Implikasi Multikolinearitas **53**  
Teknik Deteksi **53**  
Prosedur Koreksi **54**

Skala dan Unit Pengukuran **56**  
Pilihan Bentuk Fungsional **59**  
Spesifikasi Model **63**  
Stabilitas Parameter **69**  
Penggunaan Variabel Kategorik **72**  
Peramalan **78**

Beberapa Konsep Dasar **85**  
Autocorrelation Function (ACF) dan Partial ACF **87**  
Proses ARMA dan ARIMA **89**  
Pemodelan Univariat: Prosedur Box–Jenkins **91**  
Konsep Pemodelan Volatilitas **96**  
Model ARCH dan GARCH **97**  
Asymmetric GARCH **102**  
Model GARCH in Mean **106**

Fundamental dan Representasi ADL **108**  
Estimasi dan Evaluasi **109**  
Vector Auto Regression (VAR) **112**  
    Representasi dan Estimasi **112**  
    Granger Causality Test **114**  
    Impulse & Response Function dan Variance  
    Decomposition **115**  
    Catatan Aplikasi **123**

Hubungan Linier di Antara Variabel Urut Waktu **124**  
    Proses Stasioner **125**  
    Konsep Eksogenitas **127**  
    Proses Tidak Stasioner **129**  
    Implikasi Non-Stasionary: Spurious Regression **130**  
Pengujian Unit Root **132**  
    Kerangka Pengujian **133**  
    Uji Dickey Fuller **135**  
    Perkembangan Uji Unit Root **136**

Kointegrasi dan Model Koreksi Kesalahan  
(*Error Correction Model*) **142**  
    Kointegrasi: Konsep dan Pengujian **142**  
    Teknik Estimasi **144**

Tipologi Data Panel **148**  
Representasi **149**  
Model Efek Tetap (Fixed Effects Model, FEM) **150**  
Model Efek Random (Random Effect Model, REM) **151**

Model Regresi Binary Response **160**  
Variabel Terikat Multikategori **167**  
    Multinomial Logit **167**  
    Ordered Response **171**  
Poisson Regression **174**  
Censored Regression **175**

Implikasi Endogenitas: Suatu Ilustrasi **179**  
Masalah Identifikasi (Order Condition) **180**  
Teknik Estimasi: Instrumental Variable (IV) **182**  
Pengujian Endogenitas dan Overidentifying Restriction **185**  
Estimasi Sistem **190**

A. Pengenalan Eviews **195**  
B. Review Konsep Statistik **217**  
C. Tabel Statistik **237**