

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
UCAPAN TERIMA KASIH	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penulisan	4
1.4 Batasan Masalah	4
1.5 Manfaat Penulisan	5
1.5.1 Manfaat Praktis	5
1.5.2 Manfaat Teoritis	5
1.6 Sistematika Penulisan	5

BAB II LANDASAN TEORI -----	7
2.1 Data -- -----	7
2.2 Variansi Populasi -----	8
2.3 Regresi Linear -----	8
2.4 Analisis Korelasi -----	10
2.5 Metode Kuadrat Terkecil -----	12
2.6 <i>Standar Error</i> dari Taksiran <i>Least Square</i> -----	15
2.7 Teorema Gauss-Markov -----	15
2.8 Uji Normalitas Jarque-Bera -----	16
2.9 Penyimpangan Asumsi Model Klasik -----	17
BAB III MODEL DISTRIBUSI LAG DAN AUTOREGRESSIVE	
DENGAN PENDEKATAN KOYCK -----	19
3.1 Pendekatan Koyck terhadap Model Distribusi <i>Lag</i> -----	23
3.2 Pendekatan Koyck terhadap Model <i>Autoregressive</i> -----	26
3.3 Mengestimasi Parameter dengan Metode Variabel <i>Instrumental</i> -----	28
3.4 Mendeteksi Autokorelasi pada Model <i>Autoregressive</i> dengan Menggunakan Statistik h Durbin-Watson -----	30
BAB IV STUDI KASUS -----	33
4.1 Indeks Harga Konsumen -----	33
4.2 Model Distribusi <i>Lag</i> untuk Indeks Harga Konsumen Gabungan -----	35
4.2.1 Uji Normalitas Y_{t-1} -----	37

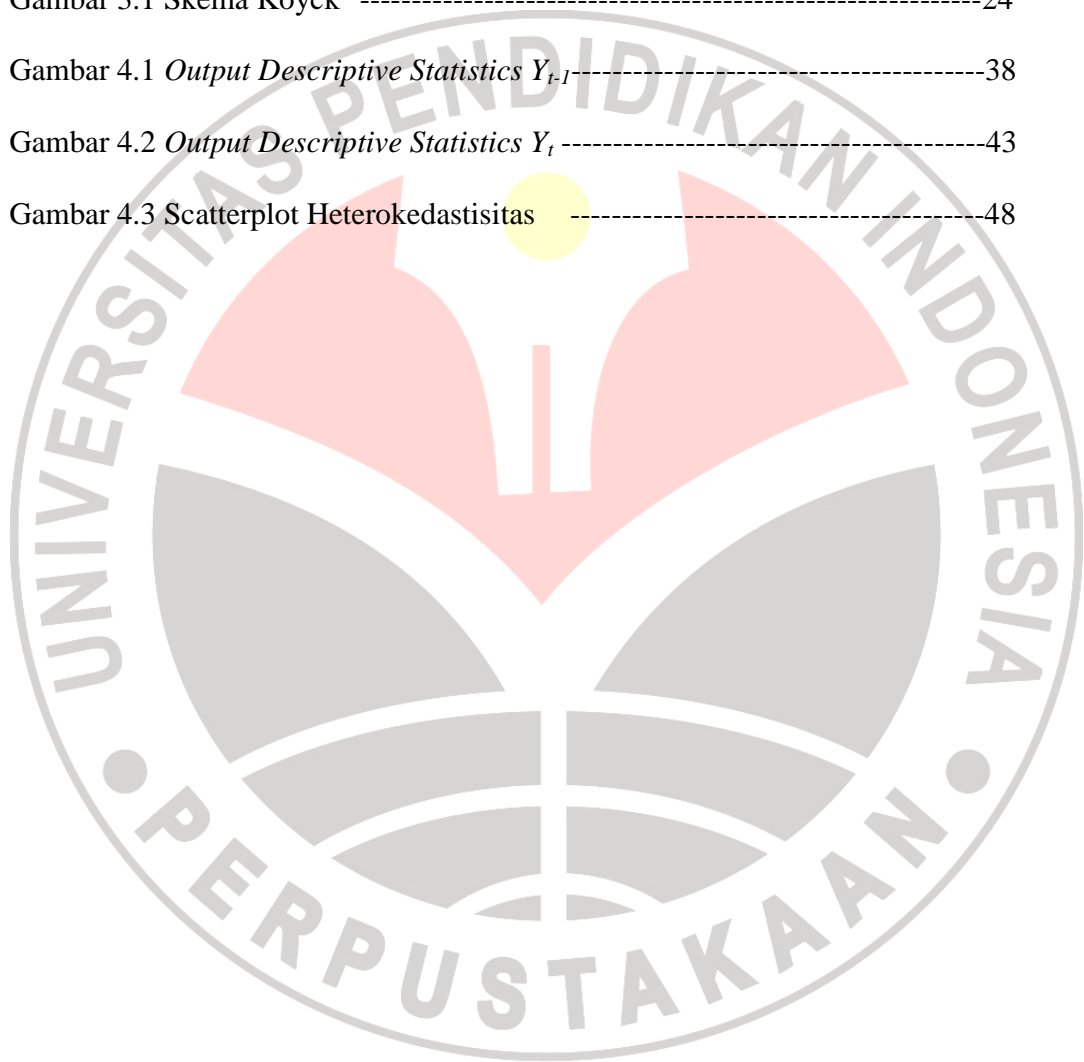
4.2.2	Uji Linieritas Y_{t-1} -----	39
4.2.3	Model Regresi \hat{Y}_{t-1} -----	40
4.2.4	Kebaikan Model \hat{Y}_{t-1} -----	40
4.2.5	Uji Keberartian Model \hat{Y}_{t-1} -----	40
4.2.6	Uji Normalitas Y_t -----	43
4.2.7	Uji Linieritas Y_t -----	44
4.2.8	Model regresi Y_t -----	45
4.2.9	Uji Kebaikan Model Y_t -----	45
4.2.10	Uji Keberartian Model Y_t -----	45
4.2.11	Uji Autokorelasi -----	46
4.2.12	Uji Multikolinearitas -----	47
4.2.13	Uji Heterokedastisitas -----	48
4.2.14	Model Distribusi <i>Lag</i> -----	49
4.3	Model <i>Autoregressive</i> Indeks Harga Konsumen Gabungan -----	50
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN -----		51
5.1	Kesimpulan -----	51
5.2	Saran -----	53
DAFTAR PUSTAKA -----		54
LAMPIRAN-LAMPIRAN -----		56
RIWAYAT HIDUP -----		76

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Indeks Harga Konsumen Gabungan 66 Kota di Indonesia -----	34
Tabel 4.2 Indeks Harga Konsumen Gabungan 66 Kota di Indonesia Setelah Dimasukkan <i>Lag</i> -----	36
Tabel 4.3 <i>Output Method: Least Squares X_{t-1}</i> -----	39
Tabel 4.4 Indeks Harga Konsumen Setelah Dimasukkan Variabel <i>Instrumental</i>	41
Tabel 4.5 <i>Output Method: Least Square X_t dan \hat{Y}_{t-1}</i> -----	44
Tabel 4.6 <i>Matriks Correlation</i> -----	47

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.1 Skema Koyck	24
Gambar 4.1 <i>Output Descriptive Statistics Y_{t-1}</i>	38
Gambar 4.2 <i>Output Descriptive Statistics Y_t</i>	43
Gambar 4.3 Scatterplot Heterokedastisitas	48



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. <i>Outoput Method: Least Square X_{t-1}</i> -----	56
Lampiran 2. <i>Outoput Method: Least Square X_t dan Y_{t-1}</i> -----	57
Lampiran 3. Menaksir Parameter Pada Model Regresi Linear dengan Metode Kuadrat Terkecil -----	58
Lampiran 4. Menaksir Parameter Pada Model Koyck dengan Metode Kuadrat Terkecil -----	60
Lampiran 5. Penurunan Rumus Variabel Bebas Y_{t-1} Stokastik dan Berkorelasi dengan <i>Error Term</i> -----	63
Lampiran 6. Sifat-sifat Statistik Taksiran Parameter $\hat{\beta}_0$, $\hat{\beta}_1$, dan $\hat{\beta}_2$ -----	65
Lampiran 7. Menentukan Sifat-sifat Statistik Taksiran dengan Menggunakan Teorema Gauss Markov -----	73