

DAFTAR ISI

| | Halaman |
|---------------------------------------|------------|
| LEMBAR PERNYATAAN | i |
| ABSTRAK | ii |
| ABSTRACT | iii |
| KATA PENGANTAR | iv |
| UCAPAN TERIMA KASIH | v |
| DAFTAR ISI | vi |
| DAFTAR TABEL | ix |
| DAFTAR GAMBAR | x |
| DAFTAR LAMPIRAN | xi |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1 Latar Belakang Masalah | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 3 |
| 1.3 Batasan Masalah | 4 |
| 1.4 Tujuan Penulisan | 4 |
| 1.5 Manfaat Penulisan | 4 |
| 1.5.1 Aspek Teoritis | 4 |
| 1.5.2 Aspek Praktis | 4 |
| 1.6 Sistematika Penulisan | 5 |
| BAB II KAJIAN PUSTAKA | 6 |
| 2.1 Matriks dan Vektor | 6 |
| 2.2 Distribusi Normal | 13 |
| 2.3 Metode Penaksiran Parameter | 15 |

| | | |
|--|---|-----------|
| 2.3.1 | Metode Kuadrat Terkecil Biasa (OLS)..... | 15 |
| 2.3.2 | Metode Kemungkinan Maksimum (<i>Maximum Likelihood Method</i>)..... | 17 |
| | Halaman | |
| 2.4 | Model-Model Regresi Linear | 18 |
| 2.5 | Penaksiran Parameter | 20 |
| 2.6 | Sifat-Sifat Penaksir Titik..... | 26 |
| 2.6.1 | Sifat-Sifat Sampel Kecil..... | 26 |
| 2.6.2 | Sifat-Sifat Sampel Besar..... | 27 |
| BAB III METODE <i>FULL INFORMATION MAXIMUM LIKELIHOOD</i> | | |
| | (FIML)..... | 29 |
| 3.1 | Model Persamaan Simultan..... | 29 |
| 3.2 | Variabel Pada Model Persamaan Simultan | 30 |
| 3.3 | Bias Persamaan Simultan | 30 |
| 3.4 | Notasi Persamaan Simultan..... | 34 |
| 3.5 | Bentuk Persamaan yang Direduksi..... | 38 |
| 3.6 | Masalah Identifikasi | 40 |
| 3.7 | Aturan Identifikasi..... | 41 |
| 3.7.1 | Kondisi Orde | 41 |
| 3.7.2 | Kondisi Rank..... | 42 |
| 3.8 | Metode Penaksiran pada Model Persamaan Simultan..... | 47 |
| 3.9 | Metode <i>Full Information Maximum Likelihood</i> (FIML)..... | 48 |
| BAB IV STUDI KASUS..... | | |
| | 58 | 58 |
| 4.1 | Model Persamaan Simultan..... | 58 |
| 4.2 | Sumber Data | 61 |
| 4.3 | Uji Normalitas | 61 |

| | |
|-------------------------------|-----------|
| 4.4 Identifikasi Model | 63 |
| 4.5 Pengujian Hipotesis | 66 |
| BAB V PENUTUP | 72 |
| 5.1 Kesimpulan..... | 72 |
| | Halaman |
| 5.2 Saran | 73 |
| DAFTAR PUSTAKA | 74 |
| LAMPIRAN..... | 76 |
| RIWAYAT HIDUP | 85 |



DAFTAR TABEL

| | Halaman |
|--|---------|
| Tabel 3.1 Identifikasi Menggunakan Kondisi Orde..... | 44 |
| Tabel 4.1 Uji Normalitas Untuk Persamaan Konsumsi Rumah Tangga..... | 62 |
| Tabel 4.2 Uji Normalitas Untuk Persamaan Konsumsi..... | 62 |
| Tabel 4.3 Identifikasi Menggunakan Kondisi Orde..... | 64 |
| Tabel 4.4 Hasil Koefisien Determinasi (R^2)..... | 66 |
| Tabel 4.5 Hasil Penaksiran Metode <i>Full Information Maximum Likelihood</i> Persamaan Konsumsi Rumah Tangga..... | 68 |
| Tabel 4.6 Hasil Penaksiran Metode <i>Full Information Maximum Likelihood</i> Persamaan Investasi..... | 68 |
| Tabel 4.7 Varians Penaksir 2SLS dan FIML..... | 71 |

DAFTAR GAMBAR

| | Halaman |
|--|---------|
| Gambar 4.1 Hubungan Antara PDB, Konsumsi Rumah Tangga, dan Investasi... 70 | |
| Gambar 4.2 Hubungan Antara Konsumsi Rumah Tangga dan Investasi..... 70 | |



DAFTAR LAMPIRAN

| | Halaman |
|--|---------|
| Lampiran 1 Data PDB..... | 77 |
| Lampiran 2 Penaksiran Parameter Dengan Variabel Instrumen..... | 79 |
| Lampiran 3 Bentuk Reduksi Pada Studi Kasus..... | 81 |
| Lampiran 4 Output Uji Normalitas..... | 82 |
| Lampiran 5 Output Hasil Penaksiran FIML..... | 83 |
| Lampiran 6 Output Hasil Penaksiran <i>Two-Stage Least Square</i> | 84 |

