

# Daftar Isi

Kata Pengantar .....	iii
Daftar Isi .....	v
<b>Bab 1    Pendahuluan .....</b>	<b>1</b>
1.1. Pendahuluan.....	1
1.2. Memulai Penelitian Data Panel .....	3
1.3. Variabel Dummy .....	8
1.4. Pengertian Intersep .....	15
1.5. Interpretasi Intersep Menggunakan Variabel Dummy.....	21
1.6. Kasus Dummy Income .....	27
1.7. Soal Latihan.....	32
<b>Bab 2    Struktur Data .....</b>	<b>35</b>
2.1 Struktur Data.....	35
2.2 Struktur Data Undated, Data tidak Konsisten Waktu .....	38
2.3 Modifikasi Data Undated untuk Karakteristik Individu .....	41
2.4 Modifikasi Data Undated untuk Dampak yang Berbeda.....	42
2.5 Struktur Data Unstacked .....	43
2.6 Struktur Data Stacked.....	49
2.7 Struktur Data Unbalance .....	53
2.8 Latihan Menyusun Data .....	56
2.9 Membuat Data STATA.....	70
2.10 Membuat Data SPSS.....	74

2.11	Memodifikasi Data Tidak Konsisten Waktu.....	76
2.12	Soal Latihan .....	77
2.13	Soal Kasus Empiris .....	78
<b>Bab 3</b>	<b>Struktur Model Common .....</b>	<b>81</b>
3.1	Pendahuluan Struktur Model .....	81
3.2	Struktur Model Umum.....	82
3.3	Membentuk Hipotesis.....	83
3.4	Estimator Model Common dengan FGLS .....	84
3.5	Estimator menggunakan OLS.....	91
3.6	Interpretasi Model Common Effect .....	92
3.7	Contoh Model Common dengan STATA.....	93
3.8	Contoh Model Common dengan SPSS.....	94
3.9	Soal Latihan .....	95
3.10	Soal Kasus Empiris .....	95
<b>bab 4</b>	<b>Struktur Model Efek Individu .....</b>	<b>99</b>
4.1	Pendahuluan Struktur Model Efek Individu.....	99
4.2	Analisis Model Efek Individu .....	104
4.3	Membentuk Hipotesis.....	105
4.4	Estimator Model Fixed Effect dengan FGLS .....	106
4.5	Model Persamaan Tunggal (LSDV) .....	116
4.6	Interpretasi Model Fixed Effect .....	125
4.7	Random Effect .....	126
4.8	Uji Random Effect .....	132
4.9	Memilih Random dan Fixed Effect .....	134
4.10	Asumsi Klasik pada Estimator FGLS.....	137
4.11	Estimasi Time Effect .....	141
4.12	Contoh Penyelesaian Menggunakan STATA .....	147
4.13	Contoh Penyelesaian Menggunakan LISREL .....	156
4.14	Contoh Model Fixed Effect dengan SPSS.....	162
4.15	Kasus Perdagangan Internasional .....	164
4.16	Soal Latihan .....	168
4.17	Soal Kasus Empiris .....	168
<b>Bab 5</b>	<b>Struktur Model Koefisien Acak .....</b>	<b>171</b>
5.1	Struktur Model Koefisien Acak .....	171
5.2	Membentuk Hipotesis.....	173
5.3	Estimator Model Koefisien Acak dengan FGLS .....	174
5.4	Estimator Model Koefisien Acak dengan LSDV .....	179
5.5	Interpretasi Model Efek Acak .....	181
5.6	Struktur Model Berkelompok.....	182
5.7	Struktur Model SURE .....	186

5.8	Interpretasi Model SURE .....	190
5.9	Contoh Estimasi Menggunakan STATA.....	191
5.10	Contoh Estimasi Model Koefisien Acak dengan SPSS .....	193
5.11	Soal Latihan .....	196
5.12	Soal Kasus Empiris .....	196
<b>Bab 6</b>	<b>Struktur Matriks Varian Covarian Residual .....</b>	<b>199</b>
6.1	Pendahuluan Struktur Matriks Varian Covarian Residual .....	199
6.2	Soal Latihan .....	229
6.3	Soal Kasus Empiris .....	229
<b>Bab 7</b>	<b>Pengujian Model .....</b>	<b>231</b>
7.1	Pendahuluan Pengujian Model.....	231
7.2	Penentuan Struktur Weights .....	253
7.3	Kasus Investasi Daerah .....	258
7.4	Soal Latihan .....	262
7.5	Soal Kasus Empiris .....	262
<b>Bab 8</b>	<b>Struktur Variabel Independen.....</b>	<b>265</b>
8.1	Fungsi-Fungsi Variabel .....	265
<b>Bab 9</b>	<b>Model Panel Simultan .....</b>	<b>281</b>
9.1	Pendahuluan Model Panel Simultan .....	281
9.2	Analisis Hubungan Variabel .....	282
9.3	Membentuk Hipotesis.....	285
9.4	Estimator Persamaan Simultan.....	287
9.5	Contoh Penyelesaian Panel Simultan.....	288
9.6	Uji Simultanitas.....	302
9.7	Contoh Uji Simultanitas .....	304
9.8	Contoh Identifikasi Persamaan Panel Simultan .....	305
9.9	Contoh penyelesaian Panel Simultan dengan LISREL .....	308
9.10	Contoh Penyelesaian Panel Simultan pada SPSS.....	318
9.11	Soal Latihan .....	323
9.12	Soal Kasus Empiris .....	324
<b>Bab 10</b>	<b>Analisis Data Panel Dinamis .....</b>	<b>327</b>
10.1	Pendahuluan GMM .....	327
10.2	Model Data Panel Dinamis .....	329
10.3	Kasus Debt Ratio .....	329
10.4	Penyelesaian dengan STATA.....	333
10.5	Soal Latihan.....	336
10.6	Soal Kasus Empiris.....	337
10.7	Lampiran .....	337

<b>Bab 11 Analisis Data Panel Nonlinier .....</b>	<b>341</b>
11.1 Pendahuluan Analisis Data Panel Nonlinier .....	341
11.2 Estimasi Persamaan Data Panel Nonlinier .....	342
11.3 Estimasi persamaan Data Panel Dinamis Nonlinier .....	350
11.4 NLDPD Untuk Efek Acak Dan Individu.....	361
11.5 Soal Latihan.....	365
11.6 Soal Kasus Empiris .....	366
<b>Bab 12 Stochastic Frontier pada Data Panel .....</b>	<b>367</b>
12.1 Stochastic Frontier pada Data Panel .....	367
12.2 Latihan Soal.....	388
12.3 Latihan Kasus Empiris .....	391
<b>Bab 13 Estimator PVECM dan PVAR.....</b>	<b>393</b>
13.1 Pendahuluan Estimator PVECM dan PVAR. ....	393
13.2 Model PVAR.....	395
13.3 Hasil pengolahan PVAR pada NPL Perbankan .....	401
13.4 Soal Pendalaman Teori .....	406
<b>Bab 14 Estimator Model NLSUR .....</b>	<b>407</b>
14.1 Estimator Model NLSUR.....	407
14.2 Estimator NLSUR pada Data Panel .....	410
14.3 Langkah-langkah Estimasi .....	411
14.4 Estimator Model NLSUR pada STATA .....	412
14.5 Contoh Penelitian dengan Model NLSUR.....	418
14.6 Soal Pendalaman Teori .....	422
14.7 Soal Kasus Empiris .....	422
<b>Daftar Pustaka.....</b>	<b>423</b>
<b>Lampiran .....</b>	<b>425</b>