Ujian Akhir Semester Genap 2010/2011

Jurusan Manajemen

Fakultas Ekonomi Unika Soegijaparanata

Matakuliah : Financial Econometrics

Dosen : Dr. A. Ika Rahutami, MSi

Sifat ujian : Take home

Catatan:

* Ujian bersifat take home
* Dikumpulkan pada hari dan jam ujian Ekonomi Indonesia berlangsung
* Jawaban ditulis tangan beserta tabel eviews yang dibutuhkan.
* Lampiran pengerjaan eviews dilampirkan

1. Jelaskan secara singkat hal-hal di bawah ini
   1. Bagaimana ekonometrika diharapkan dapat mendekati kondisi dunia nyata
   2. Mengapa dalam persamaan regresi perlu memasukkan error term?
   3. Apa syarat model ekonometri yan baik?
   4. Permasalahan specification error terkadang muncul dalam proses pembentukan model. Jelaskan mana sumber yang paling sering terjadi dalam pemodelan ekonometri, dan bagaimana cara mendeteksinya.
2. Data kuartalan dibawah ini menunjukkan Ekspor Indonesia ke Jepang dipengaruhi oleh Yen/US$, GDP jepang dan World Price Index yang menggambarkan harga dunia. Untuk itu anda diminta
   1. Membuat model ekonometrika dengan model logaritma natural model Partial Adjustment model.
   2. Membuat hipotesis pengaruh variabel independen dengan dependen
   3. Menguji stasioneritas
   4. Melakukan regrsi PAM
   5. Menguji hipotesis dengan uji t dan uji F
   6. Melakukan interpretasi hasil

| Tahun | YEN/US$ | JUTA$ | MILYAR YEN | World Price Index |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| EKSPOR INDONESIA-JEPANG | GDP JEPANG |
| 2000=100 |
| **Q1 1995** | 89.35 | 2,836.13 | 487,179.00 | 32.99 |
| **Q2 1995** | 84.60 | 3,016.05 | 491,821.00 | 33.98 |
| **Q3 1995** | 98.30 | 3,109.29 | 497,002.00 | 34.12 |
| **Q4 1995** | 102.83 | 3,326.84 | 497,682.00 | 34.64 |
| **Q1 1996** | 106.28 | 3,093.27 | 498,903.00 | 35.82 |
| **Q2 1996** | 109.42 | 3,114.33 | 503,427.00 | 36.34 |
| **Q3 1996** | 110.97 | 3,278.87 | 504,560.00 | 36.67 |
| **Q4 1996** | 116.00 | 3,398.76 | 511,105.00 | 37.57 |
| **Q1 1997** | 124.05 | 3,286.12 | 514,673.00 | 37.95 |
| **Q2 1997** | 114.40 | 3,125.36 | 516,993.00 | 37.47 |
| **Q3 1997** | 121.00 | 3,166.57 | 513,907.00 | 38.94 |
| **Q4 1997** | 129.95 | 2,906.92 | 516,647.00 | 45.17 |
| **Q1 1998** | 132.05 | 2,464.86 | 506,168.00 | 68.15 |
| **Q2 1998** | 140.85 | 2,097.77 | 502,907.00 | 77.97 |
| **Q3 1998** | 135.25 | 2,254.49 | 503,680.00 | 91.70 |
| **Q4 1998** | 115.60 | 2,298.92 | 505,774.00 | 84.11 |
| **Q1 1999** | 120.40 | 2,179.14 | 498,665.00 | 88.73 |
| **Q2 1999** | 121.10 | 2,395.36 | 499,860.00 | 88.92 |
| **Q3 1999** | 106.85 | 2,709.72 | 496,258.00 | 88.45 |
| **Q4 1999** | 102.20 | 3,112.98 | 497,571.00 | 89.49 |
| **Q1 2000** | 105.85 | 3,328.23 | 504,155.00 | 93.17 |
| **Q2 2000** | 105.40 | 3,367.00 | 502,812.00 | 97.90 |
| **Q3 2000** | 107.85 | 3,814.75 | 501,724.00 | 102.81 |
| **Q4 2000** | 114.90 | 3,905.22 | 504,529.00 | 106.12 |
| **Q1 2001** | 124.60 | 3,459.04 | 507,541.00 | 109.05 |
| **Q2 2001** | 124.05 | 3,284.26 | 501,069.00 | 116.99 |
| **Q3 2001** | 119.30 | 3,409.11 | 493,365.00 | 114.81 |
| **Q4 2001** | 131.80 | 2,857.77 | 489,424.00 | 115.76 |
| **Q1 2002** | 133.20 | 2,531.69 | 492,011.00 | 117.17 |
| **Q2 2002** | 119.45 | 2,799.06 | 490,944.00 | 116.14 |
| **Q3 2002** | 121.55 | 3,238.01 | 491,787.00 | 116.61 |
| **Q4 2002** | 119.90 | 3,476.36 | 491,029.00 | 119.44 |
| **Q1 2003** | 120.15 | 3,440.66 | 486,478.00 | 122.28 |
| **Q2 2003** | 119.85 | 3,371.57 | 490,385.00 | 118.21 |
| **Q3 2003** | 111.20 | 3,390.45 | 490,807.00 | 118.40 |
| **Q4 2003** | 107.10 | 3,400.81 | 494,584.00 | 120.20 |
| **Q1 2004** | 104.30 | 3,647.07 | 499,447.00 | 123.40 |
| **Q2 2004** | 108.38 | 3,713.73 | 497,887.00 | 129.32 |
| **Q3 2004** | 111.00 | 4,297.86 | 498,234.00 | 132.85 |
| **Q4 2004** | 104.12 | 4,303.45 | 498,164.00 | 134.56 |
| **Q1 2005** | 107.35 | 4,196.49 | 498,638.00 | 140.89 |
| **Q2 2005** | 110.40 | 4,451.77 | 501,271.00 | 146.67 |
| **Q3 2005** | 113.15 | 4,825.27 | 502,350.00 | 150.67 |
| **Q4 2005** | 117.97 | 4,575.61 | 503,368.00 | 167.00 |

1. Sebagai mahasiswa dengan konsentrasi keuangan. Jelaskan kira-kira model ekonometri apa yang bisa anda buat untuk mendukung tugas akhir anda? Variabel apa yang digunakan? Bagaimana memperoleh datanya? Bagaimana hubungan antar variabel dependen dan independen?