



**INSTITUT TEKNOLOGI SEPULUH NOPEMBER
FAKULTAS SAINS DAN ANALITIKA DATA
DEPARTEMEN STATISTIKA
PROGRAM SARJANA STATISTIKA**

Mata Kuliah

Nama Mata Kuliah	:	Ekonometrika Deret Waktu
Kode Mata Kuliah	:	SS234749
Kredit	:	3 SKS
Semester	:	VII

DESKRIPSI MATA KULIAH

Ekonometrika adalah Mata Kuliah di bidang statistik ekonomi dan keuangan. Tujuan dari Mata Kuliah ini adalah untuk dapat menerapkan metode statistika di bidang ekonomi. Di Mata Kuliah ini, mahasiswa akan belajar tentang metodologi ekonometrik dalam penelitian yang meliputi pembuatan spesifikasi model, estimasi model, evaluasi hasil estimasi model, dan evaluasi forecasting power. Model ekonometrik yang dibahas meliputi persamaan tunggal, SUR, serta persamaan simultan statis dan dinamis dengan aplikasi dalam ekonomi mikro dan makro. Dalam kuliah ini juga akan dipaparkan studi kasus untuk mengevaluasi hasil penelitian orang lain, serta pemodelan ekonometrik sehingga dapat digunakan sebagai alat dalam pengambilan keputusan untuk memecahkan masalah secara real case.

CAPAIAN PEMBELAJARAN LULUSAN YANG DIBEBAHKAN MATA KULIAH

CPL-4	Mampu menerapkan Sains dan Matematika untuk mendukung pemahaman metode statistika.
CPL-9	Mampu menerapkan metode statistika untuk menganalisis permasalahan teoritis dan riil
CPL-10	Mampu menerapkan metode statistika Bisnis, Industri, Ekonomi, Sosial, Kesehatan, atau Lingkungan pada permasalahan riil

CAPAIAN PEMBELAJARAN MATA KULIAH

CPMK.1	Memahami istilah-istilah ekonomi dan memberikan pemahaman tentang pemahaman dasar dan konsep ekonomi
CPMK.2	Mampu menjelaskan teori ekonomi (mikro dan makro) secara verbal, grafis, dan matematis
CPMK.3	Mampu menerapkan ilmu ekonomi untuk menganalisis data dalam bidang pekerjaannya dengan metode statistik yang tepat
CPMK.4	Mampu mengidentifikasi dan merumuskan permasalahan di bidang kerjanya ke dalam model ekonomi untuk memecahkan masalah
CPMK.6	Memiliki pengetahuan tentang isu-isu saat ini dan masa depan yang terkait dengan sektor ekonomi (mikro dan makro)
CPMK.7	Mampu berkomunikasi secara efektif dan bekerja sama dalam tim interdisiplin dan multidisiplin
CPMK.8	Memiliki tanggung jawab dan etika profesional
CPMK.9	Mampu memotivasi diri untuk berpikir kreatif dan belajar sepanjang hidup

POKOK BAHASAN

1. Definisi dan ruang lingkup ekonometrika deret waktu

2. Pemodelan fenomena ekonomi menggunakan pendekatan sistem persamaan SUR
3. Pemodelan fenomena ekonomi menggunakan pendekatan sistem persamaan simultan
4. Studi kasus
5. Konsep pembentukan model ARIMAX
6. Konsep pembentukan model VAR
7. Konsep pembentukan model GSTAR

PRASYARAT

Analisis Regresi, Pengantar Ekonometrika, Introduction to Time Series Analysis

PUSTAKA

1. Greene, William H. 2007. Econometric Analysis. 6th edition. Englewood Cliffs, N. J. : Prentice Hall.
2. Gujarati. 2008. Basic Econometrics. 4th edition. McGraw-Hill Companies.
3. Kmenta, J. 1986. Elements of Econometrics. 2d edition. New York: Macmillan.
4. Lutkepohl, H and Kratzig M. 2004. Applied Time Series Econometrics. First edition. Cambridge University Press.
5. Neusser K. 2016. Time Series Econometrics. Springer International Publishing Switzerland.