

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	ix
INTISARI.....	x
ABSTRACT.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	2
1.3 Batasan Masalah.....	2
1.4 Tujuan Penulisan	3
1.5 Tinjauan Pustaka	3
1.6 Metode Penulisan	5
1.7 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	7
2.1 Ekspektasi, Variansi dan Kovariansi.....	7
2.2 Distribusi Variabel Random.....	8
2.2.1 Distribusi Normal.....	9
2.2.2 Distribusi chi-square	9
2.2.3 Distribusi F	11
2.2.4 Distribusi Student t	14
2.3 Matriks.....	16
2.3.1 Operasi matriks	16
2.3.2 Transpos dan <i>trace</i> dari matriks.....	17
2.3.3 Matriks invers	18
2.3.4 Jenis matriks.....	20
2.4 Analisis Regresi Linear	21
2.5 Metode Kuadrat Terkecil.....	22
2.5.1 Asumsi klasik OLS	22
2.5.2 Estimasi fungsi regresi	24
2.5.3 Estimasi matriks kovariansi dari β	25
2.5.4 Ukuran kebaikan model	28
2.5.5 Inferensi.....	30

2.6	Heteroskedastisitas	31
2.6.1	Definisi heteroskedastisitas	32
2.6.2	Deteksi heteroskedastisitas	32
2.7	Titik <i>Leverage</i> Tinggi	33
2.8	Metode Monte Carlo untuk Uji Hipotesis	35
2.9	Metode Jackknife	37
BAB III ESTIMATOR MATRIKS KOVARIANSI YANG KONSISTEN		
	DENGAN HETEROSKEDASTISITAS	38
3.1	Estimator HC0 dan Estimator Alternatifnya	38
3.1.1	Estimator HC0	38
3.1.2	Estimator HC1	43
3.1.3	Estimator HC2	46
3.1.4	Estimator HC3	50
3.1.5	Estimator HC4	50
3.1.6	Estimator HC5	51
3.1.7	Estimator HC4m	52
3.2	Uji quasi- <i>t</i>	54
3.3	Estimator HC5m	55
3.4	Pemilihan nilai k_1 , k_2 dan k_3	56
BAB IV STUDI SIMULASI DAN IMPLEMENTASI		
4.1	Studi Simulasi	61
4.1.1	Titik <i>leverage</i> tinggi dipertimbangkan	61
4.1.2	Titik <i>leverage</i> tinggi tidak dipertimbangkan	64
4.2	Implementasi	66
4.2.1	Deskripsi Data	66
4.2.2	Deteksi titik <i>leverage</i> tinggi dan normalitas data	68
4.2.3	Model regresi OLS	70
4.2.4	Inferensi regresi linear	72
4.2.5	Uji parsial menggunakan estimator HC5m	73
4.2.6	Pemilihan Model Terbaik	76
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Kesimpulan	78
5.2	Saran	78
DAFTAR PUSTAKA		
LAMPIRAN		
		81