

RENCANA PEMBELAJARAN SEMESTER (RPS)

Mata Kuliah	: Ekonometrika
Semester	: 1 (Satu)
Kode	: MIE 604
sks	: 3 (Tiga)
Program Studi	: Ilmu Ekonomi (S2)
Dosen	:
Capaian Pembelajaran	: Setelah mengikuti mata kuliah ini, mahasiswa Magister Ilmu Ekonomi Fakultas Ekonomi dan Bisnis semester 1 akan dapat menganalisa hubungan berbagai model teori ekonomi secara kuantitatif dengan menggunakan konsep ekonometrika dengan tepat.

Minggu Ke	Kemampuan Yang Diharapkan	Bahan Kajian (Materi Ajar)	Bentuk Pembelajaran	Kriteria Penilaian (Indikator)	Bobot Nilai (%)
1	Setelah mengikuti pertemuan ini mahasiswa akan dapat : Menganalisa konsep time series ekonometrika dengan tepat	Konsep Time Series 1. Konsep Dasar 2. Analisis varians-covarians 3. Analisis autokorelasi 4. Random walk- White noise	Ceramah, Diskusi dan Latihan	UTS UAS Kuis Tugas Review Jurnal	20 20 20 20 20
2	Menganalisa stasioneritas dan kointegritas model ekonometrika dengan benar	Stasioneritas dan Co Integrasi 1. Akar Unit 2. Stasioneritas	Ceramah, Diskusi dan Latihan		
3	Mengidentifikasi proses time series dengan tepat	Proses Time Series 1. Model Autoregresive – Moving Average (ARMA) 2. Model ARIMA-ARFIMA	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
4	Menghasilkan nilai distribusi lag dengan benar	Distribusi Lag 1. Distribusi Geometrik 2. Distribusi Polinomial Lag	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		

Minggu Ke	Kemampuan Yang Diharapkan	Bahan Kajian (Materi Ajar)	Bentuk Pembelajaran	Kriteria Penilaian (Indikator)	Bobot Nilai (%)
		3. Distribusi Poisson Lag 4. Distribusi Koyck			
5	1. Mahasiswa mampu menganalisa konsep ECM dengan benar	Error Corecction Model (ECM) 1. Kointegrasi 2. Model ECM 3. Inerpretasi ECM 4. Modifikasi ECM	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
6	2. Mahasiswa mampu mejabarkan dan mengidentifikasi regresi kointegrasi dengan benar	Regresi Kointegrasi 1. Spesifikasi regresi kointegrasi 2. OLS Dinamis 3. Uji Hansen 4. Uji Park	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
7	3. Mahasiswa mampu menggunakan model ARDL dengan benar	Model Autoregresive Distributed Lag (ARDL) 1. Spesifikasi ARDL 2. Partial Adjusment Model 3. Adaptif Expeptation Model 4. General Specific Model (GSM)	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
8	Ujian Tengah Semester (UTS)				
9	4. Mahasiswa mampu menjelaskan konsep VAR dengan tepat	Vector Autoregression 1. Konsep VAR 2. Impulse Response 3. Struktural Vektor Autoregssion 4. Granger Causality	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
10	5. Mahasiswa mampu menganalisa persamaan VECM dengan benar	Vector Error Correction Model (VECM) 1. Persamaan VECM 2. Uji Stabilitas 3. Impulse Response 4. Analisis Kausalitas 5. Analisis Eksogenitas	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
11	6. Mahasiswa mampu mengidentifikasi	Metode Forecast	Ceramah,		

Minggu Ke	Kemampuan Yang Diharapkan	Bahan Kajian (Materi Ajar)	Bentuk Pembelajaran	Kriteria Penilaian (Indikator)	Bobot Nilai (%)
	metode forecast dengan tepat	1. Forecasting Non Struktural 2. Forecasting Struktural 3. Forecasting VAR – VECM 4. Forecasting Evaluation	Diskusi dan Demonstrasi		
12	7. Mahasiswa mampu menggunakan model PVAR dengan tepat	Panel Vector Autoregression (PVAR) 1. Konsep dasar 2. Model PVAR 3. Pendalaman Teori	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
13	8. Mahasiswa mampu menjelaskan model GVAR dan VARX dengan benar	Model GVAR dan VARX 1. Bayesian VAR dan GVAR. 2. Model VARX 3. Model GVAR	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
14	9. Mahasiswa mampu menggunakan panel unit root dengan benar	Panel Unit Root 1. Uji Panel unit root 2. Konsep LLC 3. Konsep Breitung 4. Konsep Hadri 5. Konsep ADF - Fisher	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
15	10. Mahasiswa mampu menjelaskan konsep panel kointegrasi dengan benar	Panel Kointegrasi 1. Persamaan dasar 2. Spesifikasi Model 3. Uji Pedroni 4. Uji Kao 5. Uji Gabungan	Ceramah, Diskusi dan Demonstrasi		
16	Ujian Akhir Semester (UAS)				

Buku Rujukan :

1. Damodar, Gujarati. **Basic Econometrics**, Fourth Edition. McGraw-Hill.
2. Nachrowi dan Hardius Usman. **Ekonometrika : Untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan**. Jakarta : LP-FEUI.
3. Manurung, Jonni. **Ekonometrika : Teori dan Aplikasi**. Jakarta : Elex Media Komputindo.

4. Ramanathan, Ramu. **Introductory Econometrics with Applications**. South-Western Thomson Learning.
5. Schmidt, Stephen J. **Econometrics**, McGraw Hill.