

ABSTRAK

Teknik analisis regresi telah banyak mengalami perkembangan. Data yang dianalisis pun semakin beragam. Perubahan-perubahan ini terjadi terutama pada data runtun waktu. Perkembangan yang terjadi muncul karena tuntutan masalah-masalah yang belum ada pemecahannya.

Salah satu masalah yang dapat muncul pada data runtun waktu adalah masalah regresi palsu. Masalah ini dapat muncul karena data yang tidak stasioner. Untuk mengetahui kestasioneran suatu data runtun waktu, dapat digunakan uji DF dan ADF.

Salah satu model yang dapat dengan tepat mengatasi masalah regresi palsu adalah model koreksi galat. Penggunaan model koreksi galat mengandaikan adanya hubungan jangka panjang di antara variabel-variabel di dalam model. Hubungan tersebut tidak selalu nyata. Ada kemungkinan hubungan yang terjadi itu palsu. Oleh karena itu, perlu untuk menguji mengenai keberadaan hubungan di antara variabel-variabel. Teknik kointegrasi dengan kembali menggunakan uji DF dan ADF dapat digunakan dalam pengujian ini. Setelah diketahui bahwa hubungan antar variabel tidak palsu, model koreksi galat dapat diduga dan disusun kembali agar model akhir yang diperoleh adalah model koreksi galat yang terbaik dan sesuai dengan teori.

Kata kunci : *regresi palsu, kestasioneran, model koreksi galat, kointegrasi, estimasi model koreksi galat*

ABSTRACT

Regression analysis technique has developed extensively. Data that analyzed is also more be variance. These changes occur particularly in the area of time series analysis. The development occure due to the unsolved problems.

One of the problems in the time series analysis is spurious regression. This problem appears because of non stationary data. The stationarity at the time series data can be detected by DF and ADF test.

Error correction model is particularly appropriate for handling spurious regression problem. The use of error correction model involved the implicit assumption that some long-term relationship exist between the variables in the model. The relationship is not always real. There ia a possibility that the relationship is spurious. Therefore, it is necessary to test such assumption. Cointegration technique by using DF and ADF test can be applied in this test. Having known that the relationship between variables is not spurious, error correction model can be estimated and arranged in order to get the best model which is fit the theory.

Keywords : *spurious regression, stasionarity, error correction model, cointegration, estimation of error correction model*