

## **ABSTRAK**

### **ANALISIS *ERROR CORECTION MODEL* (ECM) DOMOWITZ EL-BADAWI PADA DATA DERET WAKTU**

**Oleh**

**Budi Prayogo**

Banyak pemodelan ekonometrika berhubungan dengan data deret waktu. Data deret waktu yang digunakan dalam bidang ekonometrika seringkali tidak stasioner. Data deret waktu yang tidak stasioner dan koefisien determinasi tinggi serta statistik *Durbin-Watson* rendah adalah regresi lancung. Terdapat metode yang dinamakan *Error Correction Model* (ECM) Domowitz El-Badawi dalam bidang ekonometrika untuk mengatasi hal tersebut. Tujuan penelitian ini adalah mengatasi permasalahan analisis pada data deret waktu, dengan membentuk model ECM Domowitz El-Badawi. Penelitian ini diterapkan pada empat data ekonomi ( MI, Inflasi, PDB,SBD). Hasil penelitian menunjukkan model memiliki nilai ECT sebesar 0,1733 (nilai positif), artinya model yang digunakan sudah valid. Model yang dihasilkan memiliki nilai koefisien determinasi 0,9757 dan statistik *durbin-watson* 2.6122, yang menunjukkan model baik untuk digunakan sebagai pendekatan dalam menentukan model ekonomi yang berkaitan dengan data deret waktu.

Kata kunci : *Ekonometrika, Error Correction Model, Domowitz El-Badawi.*

## **ABSTRACT**

### **ANALISIS *ERROR CORECTION MODEL* (ECM) DOMOWITZ EL-BADAWI PADA DATA DERET WAKTU**

**By**

**Budi Prayogo**

There are many modeling econometrics that has correlation with time series. Time series was used in econometrics field often is not stasioner. Time series which not stasioner and high determination coefficient and Durbin Watson statistic is low, it means that spurious regression. There is method which named by Error Correction Model (ECM) Domowitz El-Badawi in sector econometrics to solve the problem. The purpose in this research to solve the problem of analysis in time series. With making ECM Domowitz El-Badawi model. In this research there are four economic data those are ( MI, Inflasi, PDB,SBD). The result show that the model has ECT value the amount of 0,1733 (positive value). It means that, the model which used is valid. The model has result the amount of determination coefficient 0,9757 and durbin-watson stastistic 2.6122. It show that, the model is proper for using as approach to determine economic model which related with time series.

**Keywords :** *Econometrics, Error Correction Model, Domowitz El-Badawi.*