

Aplikasi Penelitian Keuangan dan
Ekonomi Syariah dengan

STATA

Dr. Faisol, S.Pd., MM
Dr. Agus Eko Sujianto, MM



PENERBIT
CAHAYA ABADI

• Dr. Faisol, S.Pd., MM • Dr. Agus Eko Sujianto, SE., MM

APLIKASI PENELITIAN KEUANGAN DAN EKONOMI SYARIAH DENGAN STATA



ANGGOTA IKAPI NO. 121/JTI/2010



APLIKASI PENELITIAN KEUANGAN DAN EKONOMI SYARIAH DENGAN STATA

Oleh:

Dr. Faisol, S.Pd.,MM dan Dr. Agus Eko Sujianto, SE.,MM

Hak Cipta Dilindungi dengan Undang-Undang, dilarang keras mengutip, menjiplak, memfotokopi sbagian atau seluruh isi buku ini serta memperjualbelikannya tanpa izin tertulis dari Penerbit CAHAYA ABADI.

Diterbitkan oleh:

Penerbit CAHAYA ABADI

Email: agusekosujianto@gmail.com

Telp. 085234635471

Editor: Khusnul Mufidati

Dr. Faisol, S.Pd.,MM dan Dr. Agus Eko Sujianto, SE.,MM

Aplikasi Penelitian Keuangan dan Ekonomi Syariah dengan STATA; Dr. Faisol, S.Pd.,MM dan Dr. Agus Eko Sujianto, SE.,MM : editor, Khusnul Mufidati – Tulungagung : Cahaya Abadi, 2020.

111 hlm. ; 24 cm

ISBN: 978-602-8569-77-4

Anggota Ikatan Penerbit Indonesia No. 121/JTI/2010

KATA PENGANTAR

Pertama-tama penulis mengucapkan puji yukur kepada Allah SWT yang telah memberikan kemampuan pikir dan pencerahan untuk berbuat lebih baik daripada hari kemarin, dan dengan penuh harapan juga akan lebih baik pada hari yang akan datang, dimana penulis telah membuat dan menyusun buku ini, sehingga buku ini dapat tersaji dengan segala kekurangan dan keterbatasan kami sebagai penulis.

Dengan semakin kompleks dan berkembangnya data-data penelitian ekonomi, dan keuangan, penguasaan perangkat lunak pengolahan dan analisis data adalah sangat relevan dan dibutuhkan untuk membentuk mahasiswa memiliki kemampuan penelitian yang memadai. Dalam hal ini STATA memberikan banyak varian dan menyediakan berbagai fitur untuk analisis data, manajemen data, dan grafik. STATA memberikan kita berbagai fasilitas alat analisis yang dibutuhkan untuk mengatur dan mengelola data kita dan juga memperoleh serta menghasilkan hasil analisis statistik. STATA memiliki beberapa dokumentasi dasar (seperti User's Guide) yang dapat digunakan oleh pembaca untuk memahami informasi yang lebih detail terkait setiap bahasa perintah yang digunakan di dalam program

Buku ini ditujukan untuk memperkenalkan mahasiswa kepada pengolahan dan penganalisisan data penelitian yang ada. Diharapkan melalui buku ini, mahasiswa dapat menggunakan perangkat lunak untuk membantu melakukan analisis penelitian kuantitatif di bidang ekonomi dan keuangan.

Topik yang dibahas dan dijelaskan dalam buku ini hanya difokuskan pada pembelajaran STATA tingkat dasar, yakni pengantar singkat STATA kemudian dilanjutkan dengan bagaimana mengoperasikan STATA. Kemudian, dijelaskan beberapa perintah dalam analisis deskriptif dengan tabel dan grafik. Di Bab 4 dijelaskan analisis regresi data panel di lengkapi dengan tahapan pengujian pemilihan model yakni common effect, fixed effect dan random effect, selanjutnya konsep asumsi klasik adalah bagian penting dalam model regresi, diuraikan secara sederhana dan spesifik. Di Bab 4 memberikan contoh kasus tahapan analisis time series yakni VECM, Uji Stasioner, uji lag optimal, uji kointegrasi, uji model VEC, dan dilengkapi dengan IRF dan FEVD. Di bagian akhir, penulis menjelaskan secara singkat analisis data primer dengan SEM, yakni uji validitas dan uji reliabilitas

Kami menyadari bahwa masih terdapat banyak kekurangan dalam modul ini, oleh karena itu kami sangat mengharapkan saran dan kritik konstruktif untuk perbaikan modul ini di kemudian hari.

Penulis mengucapkan banyak terima kasih kepada banyak pihak yang berkontribusi memberikan masukan buku ini, baik dari segi motivasi maupun

dari segi materi. Juga kepada penerbit buku ini, penulis mengucapkan terima kasih sehingga buku ini dapat sampai ke tangan para pembaca. Buku ini dilengkapi dengan CD yang berisi data dalam file excel yang dapat digunakan dalam analisis, workfile program STATA. Harapan penulis buku ini akan melengkapi buku-buku statistik yang telah terbit sebelumnya. Tentunya buku ini masih banyak kekurangannya, untuk itu penulis menunggu masukan dalam rangka perbaikan lebih lanjut.

Kediri, 21 Desember 2020
Penulis

DAFTAR ISI

BAB I	Pengenalan Tentang STATA.....	1
1.1	Pengantar singkat STATA	1
1.2	Menginstall STATA	3
1.3	Tampilan STATA	4
1.4	Perintah Dasar untuk Penggunaan Awal	7
1.5	Data dan Variabel 11	
BAB II	ANALISIS DESKRIPTIF	17
2.1.	Analisi Deskriptif dengan STATA.....	17
2.2.	Menggunakan Tabel dan Grafik Statistik Deskriptif pada STATA	21
BAB III	ANALISIS REGRESI.....	25
3.1.	Analisis Regresi Linier	25
3.2.	Hipotesis	26
3.3.	Analisis Regresi Sederhana	27
3.4.	Pendeteksian dan Pengoreksian Pelanggaran Asumsi	31
BAB IV	ANALISIS REGRESI DENGAN DATA PANEL	45
4.1.	Analisis Menggunakan Data Panel.....	45
4.2.	Analisis Regresi Data Panel.....	51
	4.2.1. Menentukan Model Estimasi Data Panel	55
	4.2.2. Uji Asumsi Klasik	60
BAB V	Vector Error Correction Model (VECM).....	63
5.1.	Tahapan Model Vector Error Correctin	63
5.2.	Uji Stasionaritas	65
5.3.	Uji Lag Optimal	68
5.4.	Uji Kointegrasi	71
5.5.	Uji Model Vector Error Correction	72
5.6.	Analisis IRF dan FEVD	76
	5.6.1 Impulse Response Function	76
	5.6.2 Forcasting Error variance Decomposition	78
BAB VI	REGRESI LOGIT dan PROBIT	81
6.1.	Regrei Logit	81
6.2.	Regresi Probit	82
6.3.	Marginal Effect	82

6.4.	Menjalankan Regresi Logit dengan STATA	83
6.5.	Menjalan Regresi Probit dengan STATA	84
6.6.	Tahapan melakukan regresi Logit dan Probit	85
BAB VII ANALISIS KUESIONER MENGGUNAKAN STATA		99
7.1.	Analisis Data Primer dengan STATA	99
7.2.	Uji Validitas	102
7.3.	Uji Reliabilitas	106
Daftar Referensi	109
BIODATA PENULIS	111

BAB I

PENGENALAN TENTANG STATA

1.1 Pengantar Singkat STATA



(sumber: www.stata.com)

STATA adalah salah satu program statistik yang powerful yang dikembangkan oleh StataCorp dan banyak digunakan di dalam analisis bidang ilmu ekonomi dan keuangan. Dengan STATA peneliti dapat dengan mudah menganalisis data kuantitatif baik itu menggunakan data cross-section, panel atau time series. STATA menyediakan berbagai fitur untuk analisis data, manajemen data, dan grafik. STATA memberikan kita berbagai fasilitas alat analisis yang dibutuhkan untuk mengatur dan mengelola data kita dan juga memperoleh serta menghasilkan hasil analisis statistik seperti

1. ANOVA/MANOVA
2. Model linear
3. Metode Survey
4. Model generlized linear
5. Logistic regresi
6. Probit regresi
7. Regresi linear
8. Analisis cluster
9. Data Panel/Longitudinal
10. Analisis Time Series (seperti ARIMA, ARMAX, ARCH, VAR, VECM),
11. Analisis Model Persamaan Struktural (Structural Equation Modeling).