

Estimasi model spasial dependen dengan metode generalized spatial two stage least squares

Erma Harviani, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=126501&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam penerapan analisis regresi seringkali terdapat efek dependensi spasial (lokasi) yaitu nilai observasi variabel dependen pada suatu lokasi bergantung pada nilai observasi di lokasi lain. Karakteristik ini dinamakan spasial lag. Bentuk dependensi lain adalah spasial error yaitu error pada suatu lokasi dipengaruhi oleh error pada lokasi sekitarnya. Model regresi yang melibatkan efek dependensi spasial disebut model spasial dependen. Dalam kenyataannya tidak tertutup kemungkinan spasial dependen pada data cross section memiliki kedua karakteristik dependensi spasial. Tugas akhir ini membahas tentang prosedur mengestimasi parameter model dengan kedua jenis spasial dependen, yaitu spasial lag sekaligus spasial error dengan metode Generalized Spatial Two Stage Least Squares (GS2SLS). Metode ini menggunakan Two Stage Least Squares, Generalized Moment, dan transformasi Cochrane-Orcutt. Taksiran yang dihasilkan bersifat konsisten. Kata Kunci: Spasial Lag, Spasial Error, Two Stage Least Squares, Generalized Moment, Transformasi Cochrane-Orcutt.