

Penaksiran parameter pada model panel data dinamis menggunakan metode Arellano dan bond

Bernadeta Nismawati, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20339994&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam model panel data dinamis terdapat lag dari variabel dependen yang menyebabkan variabel eksplanatori berkorelasi dengan error. Lag dari variabel dependen tersebut dinamakan variabel endogen eksplanatori. Dengan adanya variabel endogen eksplanatori, estimasi secara OLS menjadi bias dan inkonsisten. Oleh karena itu sebelum menaksir parameter pada model panel data dinamis harus dilakukan first-difference untuk menghilangkan efek individu dan selanjutnya dilakukan instrumental variabel pada variabel endogen eksplanatori. Kemudian untuk mendapatkan taksiran yang unbiased, konsisten, dan efisien, model ini ditaksir dengan metode Arellano dan Bond yang menggunakan prinsip GMM optimal.