

Penaksiran parameter pada model regresi data panel spasial dinamis

Dwi Rani Puspa Artha, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20340169&lokasi=lokal>

Abstrak

Pada model regresi data panel spasial dinamis terdapat lag dari variabel dependen dan spatial lag dari variabel dependen yang berperan sebagai variabel eksplanatori. Hal ini menyebabkan variabel eksplanatori berkorelasi dengan error, variabel jenis ini disebut variabel endogen eksplanatori. Dengan adanya variabel ini, estimasi secara ordinary least squares menjadi bias dan tidak konsisten. Oleh karena itu sebelum menaksir parameter pada model regresi data panel spasial dinamis harus dilakukan first-difference untuk menghilangkan efek individu dan selanjutnya dilakukan instrumental variabel pada variabel endogen eksplanatori. Kemudian untuk mendapatkan unbiased and consistent estimator, model ini ditaksir dengan metode Arrelano dan Bond yang menggunakan prinsip generalized method of moments optimal.