

Penggunaan metode feasible generalized least square (FGLS) pada model regresi untuk data panel tidak lengkap

Rimbun Budiman

Deskripsi Dokumen: <http://lib.ui.ac.id/opac/themes/libri2/detail.jsp?id=20338730&lokasi=lokal>

Abstrak

Data Panel merupakan kombinasi dua jenis data yaitu data cross section dan data time series. Tujuan dari penulisan tugas akhir ini adalah mencari taksiran parameter pada model regresi untuk data panel yang tidak lengkap (incomplete panel data regression models) dengan komponen error satu arah (one-way error component). Selain itu model regresi tersebut merupakan random effect models, yang berarti perbedaan karakteristik individu dan waktu diakomodasikan pada komponen error dari model. Metode yang digunakan untuk menaksir parameter adalah metode Feasible Generalized Least Squares (FGLS). Pada metode tersebut, matriks kovarians error tidak diketahui, sehingga perlu dilakukan penaksiran terhadap komponen variansi yang terdapat pada matriks kovarians error tersebut. Metode yang digunakan untuk menaksir komponen variansi adalah modifikasi metode penaksiran ANOVA yang diusulkan oleh Wallace dan Hussain.