

Penaksiran parameter model regresi data panel hausman taylor

Novianty H., author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20182057&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam dunia ekonomi, terdapat variabel yang tidak berubah terhadap waktu dan mempengaruhi variabel dependen, sehingga Hausman dan Taylor mengadakan penyesuaian untuk model data panel biasa. Model data panel Hausman Taylor merupakan model data panel yang memperhitungkan adanya time variant variable dan time invariant variable. Jika pada model data panel Hausman Taylor terdapat variabel penjelas yang dicurigai berkorelasi dengan efek individu, maka penaksiran parameter dengan metode OLS menjadi bias dan inkonsisten. Oleh karena itu, untuk mendapatkan estimasi parameter model yang konsisten dan efisien, maka digunakan instrument variable, dan metode penaksiran yang digunakan adalah Generalized Method of Moment dan Two Stage Least Square.