

Membandingkan mse dari taksiran particular ridge dan least square pada kasus omitted variables = Compare the mse of least square and ridge particular estimator in omitted variables case / Dwi Oktavianti

Dwi Oktavianti, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20388236&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam bidang ekonomi, peneliti sering tertarik untuk mencari taksiran particular dari sebuah model regresi linier berganda. Namun, keberadaan omitted variables di dalam model menyebabkan mean dari error pada model tersebut bernilai tidak nol. Hal ini mengakibatkan taksiran particular least square bersifat bias. Oleh karena itu, menurut Ryo Uemukai (2010) ada cara lain untuk mencari taksiran particular dari model regresi yang memiliki omitted variables yaitu Regresi Ridge (RR). Pada skripsi ini akan dicari taksiran particular dari sebuah model regresi linier berganda yang memiliki omitted variables dengan menggunakan OLS dan RR. Selain itu, akan dilihat pengaruh omitted variables terhadap kedua taksiran particular tersebut, dari segi bias serta MSE. Untuk melihat taksiran mana yang lebih baik, peneliti membandingkan nilai MSE taksiran particular least square dengan MSE taksiran particular ridge. Pada tugas akhir ini juga akan dijelaskan syarat – syarat yang harus dipenuhi agar MSE taksiran particular ridge memiliki nilai yang lebih kecil dibandingkan MSE taksiran particular least square.

.....

In Economic studies, researcher often interested in searching for a particular estimation over a multiple linier regression model. But, the existence of omitted variables in the model causing mean value of the error from model has no zero. This caused the particular least square estimation biased. Ryo Uemukai (2010) then pointed out that there's other way to estimate the particular estimation from regression model with omitted variables, called Ridge Regression (RR). In this paper, we will estimate the particular estimation from a multiple linier regression model using OLS and RR. Omitted variables' effect towards both of the particular estimation will also be observed, based on bias and MSE value. To decide which estimation is better, researcher compare the MSE least square and MSE ridge. This paper also explains the condition that must be fullfiled so that MSE of particular ridge estimations smaller than least square.