

BAB VI

KESIMPULAN

Meskipun penaksir kuadrat terkecil tetap tidak bias dengan adanya autokorelasi, penaksir tadi tidak lagi efisien (varians tidak minimum lagi). Bahkan taksiran dari varians σ^2 menjadi taksiran yang bias. Dengan demikian interval kepercayaan dan pengujian hipotesa untuk parameter akan membuat kesimpulan yang salah. Jadi tindakan perbaikan sangat diperlukan.

Sebelum perbaikan, perlu mengetahui terlebih dahulu apakah autokorelasi terdapat atau tidak dalam suatu observasi. Meskipun ada beberapa metode, namun metode yang sering dipakai adalah metode grafik dan uji Durbin-Watson yang merupakan uji yang lebih akurat dari metode-metode lain.

Dari contoh aplikasi tampak bahwa dengan menggunakan uji Durbin-Watson, ada tidaknya autokorelasi dapat dideteksi dan dengan iterasi Cochrane-Orcutt telah dapat menyelesaikan persoalan autokorelasi.