

BAB IV

KESIMPULAN

Salah satu asumsi penting dalam model regresi linier sederhana adalah kesalahan (ε_i) semuanya mempunyai varians yang sama. Jika asumsi ini tidak dipenuhi maka disebut heteroskedastisitas.

Heteroskedastisitas tidak merusak ketidakbiasan dan konsistensi dari pada estimator kuadrat terkecil biasa ($\hat{\alpha}$ dan $\hat{\beta}$). Tetapi estimator tersebut tidak mempunyai varians yang minimum, dengan kata lain tidak lagi BLUE (Best Linear Unbiased Estimator). Sedangkan akibat terhadap $\hat{\sigma}^2$ adalah menjadi bias.

Dengan metode grafik dapat diketahui pola-pola heteroskedastisitas seperti hubungan linier, hubungan kuadratik antara $\hat{\sigma}_i^2$ dengan variabel bebas X ataupun dengan \hat{Y}_i . Sehingga akan memudahkan untuk mentransformasikan modelnya.

Kelemahan dari uji Park adalah v_i pada persamaan (3.7) mungkin dirinya sendiri heteroskedastisitas, tetapi uji ini tetap dianjurkan untuk mendeteksi adanya heteroskedastisitas. Sedangkan pada uji Goldfeld - Quandt pemilihan terbaik untuk p observasi yang dihilangkan adalah 8 jika $n = 30$ dan 16 jika $n = 60$.

Setelah mengetahui akan adanya heteroskedastisitas dalam model, maka harus ada tindakan perbaikan yaitu dengan mentransformasikan model asli sedemikian rupa

sehingga asumsi homoskedastisitas dapat terpenuhi.

Dari kesimpulan diatas, sebaiknya dalam penggunaan regresi linier diperiksa lebih dahulu apakah seluruh asumsi-asumsinya sudah terpenuhi atau belum. Sehingga nantinya akan didapatkan suatu hasil yang sesuai dengan kenyataan yang sebenarnya dari data yang kita olah tersebut.

