

INTISARI

TEKNIK ESTIMASI PARAMETER DAN KOMPONEN EEROR PADA DATA PANEL TIDAK LENGKAP DENGAN LSDV DAN FGLS

Oleh

Darman Saputra

13/354866/PPA/04311

Di dalam tesis ini dibahas data panel tidak lengkap fixed effect dan random effect satu arah dan dua arah. Pada fixed effect satu arah dan dua arah digunakan metode Least Square Dummy Variable (LSDV) yang mengasumsikan intersep bervariasi antar individu maupun antar waktu, sedangkan slope-nya konstan.

Pada random effect, perbedaan karakteristik individu dan waktu diakomodasikan pada komponen error dari model dengan matriks kovarians error tidak diketahui. Metode yang digunakan untuk satu arah adalah Feasible Generalized Least Square (FGLS). Tesis ini membahas pengaruh PDRB Migas dan PDRB Non Migas terhadap pendapatan per kapita di provinsi Bangka Belitung. Data diperoleh dari Badan Pusat Statistik Provinsi Bangka Belitung untuk periode 2006-2013. Software yang digunakan dalam model data panel tidak lengkap seperti R, Eviews, Stata dan sebagainya. Tesis ini software yang digunakan untuk menganalisis data dalam tesis ini adalah dengan R.

Kata kunci : Data panel tidak lengkap, Least Square Dummy Variable (LSDV), Feasible Generalized Least Square (FGLS), R.

ABSTRACT

TECHNICAL PARAMETERS AND COMPONENT ERROR ESTIMATES ON PANEL DATA INCOMPLETE AND WITH LSDV FGLS

by

Darman Saputra

13/354866/PPA/04311

Discussed in this thesis is incomplete panel data fixed effect and random effect one-way and two-way. In the fixed effects one-way and two-way used method of Least Square Dummy Variable (LSDV) by assuming the intercept varies between individuals and time, whereas the slope is constant. Dummy variable used to determine differences the intercept on the classification individual or time units.

For the random effects, differences in characteristics individual and time accommodated on the error component model with unknown error covariance matrix. The method used for one-way is Feasible Generalized Least Square (FGLS). This thesis discusses the influence of oil and gas GDP and Non-Oil GDP for the per capita income in the province of Bangka Belitung. Data obtained from the Central Statistics Agency Bangka Belitung province for the period 2006-2013. Software used in panel data model is incomplete as R, Eviews, Stata and etc. This thesis software used to analyze of data a thesis is with R.

Keywords: Panel data is not complete; Least Square Dummy Variable (LSDV); Feasible Generalized Least Square (FGLS); R.