

PENDUGAAN PARAMETER REGRESI PANEL DINAMIS MENGGUNAKAN

BLUNDELL AND BOND GENERALIZED METHOD OF MOMENT

SKRIPSI SARJA MATEMATIKA

Oleh

AZMI ARSA

1210431010



Pembimbing :

1. Yudiantri Asdi, M.Sc

2. Dr. Ferra Yanuar

JURUSAN MATEMATIKA

FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM

UNIVERSITAS ANDALAS

PADANG

2017

ABSTRAK

Model regresi data panel dinamis merupakan model regresi data panel yang melibatkan lag dari peubah bebas sebagai peubah penjelas yang berkorelasi dengan eror. Lag dari peubah bebas tersebut dinamakan peubah endogen penjelas. Adanya peubah endogen penjelas menyebabkan pendugaan parameter dengan metode kuadrat terkecil menghasilkan dugaan yang bias dan tidak konsisten.

Kata Kunci : variabel instrument, momen, pendugaan parameter.

