

BAB I

PENUTUP

1.1 Kesimpulan

Metode Regresi kuantil yang diperkenalkan oleh Koenker dan Bassett (1978) merupakan cara pendugaan dengan menggunakan pendekatan fungsi kuantil dari suatu distribusi Y sebagai fungsi dari peubah penjelas X . Regresi kuantil adalah suatu metode pendugaan yang digunakan sebagai gambaran yang lengkap tentang bagaimana setiap kuantil untuk distribusi bersyarat Y diberi $X = x$ bergantung terhadap x . Berdasarkan pembahasan dari bab sebelumnya diperoleh kesimpulan :

1. Regresi kuantil dapat digunakan untuk mengatasi keterbatasan regresi linear dalam menganalisis asumsi yang tidak terpenuhi pada regresi klasik, yaitu varians error bersifat tidak konstan (heteroskedastisitas).
2. Heteroskedastisitas dapat dideteksi dengan menggunakan uji *Breusch-Pagan Godfrey* (BPG). Jika terdapat masalah heteroskedastisitas pada error, metode regresi kuantil lebih tepat untuk mengatasi masalah tersebut.
3. Dari analisis yang dilakukan diperoleh bahwa estimasi metode kuantil bayesian

menghasilkan *standard error* yang lebih kecil dari metode kuantil. Hal ini mengindikasikan bahwa estimasi dengan metode kuantil bayesian lebih baik. Sedangkan nilai R^2 masing-masing kuantil pada kedua metode estimasi menghasilkan nilai R^2 yang lebih dari 90%.

1.2 Saran

Pada penelitian ini untuk mengatasi masalah heteroskedastisitas adalah dengan regresi kuantil, dan model regresi kuantil dengan metode Bayesian yang dibahas adalah model linear. Untuk penelitian selanjutnya, peneliti menyarankan menggunakan metode lain untuk mengatasi masalah heteroskedastisitas dan meneliti model selain model linear seperti model nonparametrik, model semiparametrik, dan lainya.

