

V. KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil dan pembahasan yang telah dilakukan, dapat disimpulkan sebagai berikut :

1. Penduga parameter dengan metode GLS pada kasus heteroskedastisitas menghasilkan :
 - a. Nilai penduga β yang mendekati nilai sebenarnya dan jika keheterogenan varians semakin diperkecil maka penduga yang dihasilkan akan semakin mendekati nilai sebenarnya.
 - b. jika β menjauh dari asumsi H_0 maka kuasa uji yang didapat akan bertambah besar, hal ini berarti dengan menjauhnya β dari asumsi H_0 maka peluang untuk menolak H_0 dimana H_0 salah semakin besar (mendekati satu). Nilai kuasa uji juga akan bertambah besar ketika keheterogenan dari varians data diperkecil, sehingga semakin homogen varians maka kuasa ujinya pun semakin besar.
2. Penduga parameter dengan metode GLS pada kasus autokorelasi menghasilkan:
 - a. Nilai penduga β yang mendekati nilai sebenarnya dan jika korelasi antar pengamatan semakin diperkecil maka penduga yang dihasilkan tetap tidak

menunjukkan perbedaan. Jika semakin kecil korelasi antar pengamatan maka akan diperoleh $\hat{\sigma}^2$ yang mendekati nilai parameter. Akan tetapi jika korelasi antar pengamatan diperbesar maka $\hat{\sigma}^2$ yang diperoleh semakin besar dan jauh dari nilai parameter.

- b. Kuasa uji terkecil disaat $\beta = \beta_2 = \{0, 0, 0, 0\}$, tetapi untuk β selanjutnya, nilai kuasa uji yang didapat bernilai satu, karena sesuai dengan F-hitung yang sangat besar sehingga peluang untuk menolak H_0 dimana H_0 salah juga sangat besar.

5.2 Saran

Masih banyak penelitian yang perlu dikaji dalam pendugaan parameter pada metode lainnya. Oleh karena itu penulis mengharapkan kepada para pembaca untuk menelaah lebih lanjut. Penulis juga mengharapkan supaya menyempurnakan program makro yang telah penulis buat.