

ABSTRACT

***RIDGE ROBUST-MM* REGRESSION ANALYSIS TO HANDLE MULTICOLLINEARITY AND NON-NORMALITY**

By

WAHYU HIDAYAT TULLAH

Ridge robust-MM regression is a method that can solve multicollinearity and non-normality data in regression model. The purpose of this study is to know the performance of *ridge robust-MM* regression to handle multicollinearity and non-normality data and compare its estimates with OLS. The results show that *ridge robust-MM* regression gives better estimator in handling multicollinearity and non-normality than OLS based on the value of regression coefficient, MSE and AMSE .

Keywords: *ridge robust-MM* regression, multicollinearity, non-normality, MSE, AMSE

ABSTRAK

ANALISIS REGRESI *RIDGE ROBUST-MM* UNTUK MENGATASI DATA MULTIKOLINEARITAS DAN TIDAK NORMAL

Oleh

WAHYU HIDAYAT TULLAH

Regresi *ridge robust-MM* merupakan sebuah metode yang dapat digunakan untuk mengatasi data multikolinearitas dan tidak normal dalam model analisis regresi. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui kinerja metode regresi *ridge robust-MM* dalam menangani data yang mengandung multikolinearitas dan tidak normal serta membandingkan nilai dugaannya dengan menggunakan MKT. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa regresi *ridge robust-MM* lebih baik dalam menangani data multikolinearitas dan tidak normal dibandingkan dengan MKT berdasarkan nilai dari koefisien regresi, MSE dan AMSE.

Kata Kunci: regresi *ridge robust-MM*, multikolinearitas, data tidak normal, MSE, AMSE