



ASUMSI HETEROKEDASTISIDAS

UJI ASUMSI KLASIK

Uji Heteroskedastisitas

- Uji heteroskedastisitas digunakan untuk mengetahui ada atau tidaknya penyimpangan asumsi klasik heteroskedastisitas yaitu adanya ketidaksamaan varian dari residual untuk semua pengamatan pada model regresi
- Uji heteroskedastisitas bertujuan untuk menguji apakah dalam model regresi linear terjadi ketidaksamaan varians dari residual satu pengamatan ke pengamatan yang lain.
- Model regresi yang baik adalah yang homoskedastisitas atau tidak terjadi heteroskedastisitas.
- rumus regresi diperoleh dengan asumsi bahwa variabel pengganggu (*error*) atau e , diasumsikan memiliki variabel yang konstan (rentangan e kurang lebih sama). Apabila terjadi varian e tidak konstan, maka kondisi tersebut dikatakan tidak *homoskedastik* atau mengalami *heteroskedastisitas*

Pendeteksian Heteroskedastisitas

- Untuk mendeteksi ada tidaknya heteroskedastisitas, dapat dilakukan dengan berbagai cara seperti uji grafik, uji Park, Uji Glejser, uji *Spearman's Rank Correlation*, dan uji Whyte menggunakan Lagrange Multiplier
- Masalah heteroskedastisitas lebih sering muncul dalam data *cross section* dari pada data *time series*
- Karena dalam data *cross section* menunjukkan obyek yang berbeda dan waktu yang berbeda pula. Antara obyek satu dengan yang lainnya tidak ada saling keterkaitan, begitu pula dalam hal waktu.
- Sedangkan data *time series*, antara observasi satu dengan yang lainnya saling mempunyai kaitan. Ada trend yang cenderung sama. Sehingga *varians* residualnya juga cenderung sama.

Uji Heteroskedastisitas

Ada cara mendeteksi ada atau tidaknya heteroskedastisitas, yaitu :

- Uji Goldfeld-Quandt
- Uji Korelasi Spearman
- Uji Glejser
- Uji White
- Uji Bruesch-Pagan-Godfrey
- dll

Cara Mengobati Heteroskedastisitas

- ***White Heteroskedasticity / Robust Standard Error***

Langkahnya melalui *E-views* adalah dengan melakukan blok terhadap seluruh variabel → klik kanan → pilih *open as equation* → option → *heteroskedasticity consistent coefficient variance* → *white* → ok

- ***Melakukan Transformasi Model dalam bentuk Log***

Transformasi model dilakukan dengan merubah nilai variabel dalam bentuk logaritma natural