

Penaksir Regresi Ridge yang Robust Terhadap Pencilan

Abdul Kudus

Dosen Tetap Jurusan Statistika FMIPA-UNISBA
Jln. Tamansari No.1 Bandung 40116

Abstrak

Analisis regresi pada data yang mempunyai gejala multikolinieritas dan mengandung pencilan merupakan hal yang menarik. Penaksir Kuadrat Terkecil untuk parameter regresi pada data yang mempunyai dua sifat tadi mempunyai beberapa kelemahan. Hal ini menjadi dorongan untuk menemukan suatu metode penaksiran parameter regresi yang dapat mengatasi hal-hal yang tidak diinginkan akibat adanya gejala multikolinieritas dan kehadiran pencilan. Metode regresi ridge merupakan salah satu cara untuk mengatasi gejala multikolinieritas dan metode penaksiran robust merupakan cara untuk mengatasi kehadiran pencilan. Kedua cara itu akan digabungkan untuk mendapatkan penaksir parameter regresi yang dapat mengatasi gejala multikolinieritas dan bersifat robust terhadap pencilan.

Kata Kunci: Regresi Ridge, Robust, Pencilan, Simulasi.