

Keterangan :

Ho : Ada autokorelasi positif

Ha : Ada autokorelasi negatif

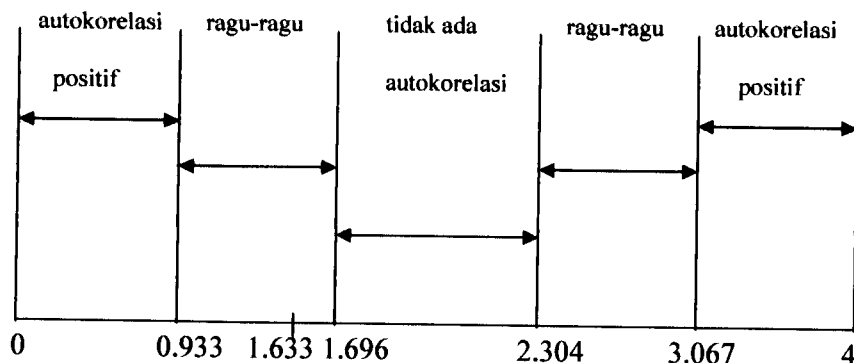
5.5.2 Uji Heteroskedastisitas

Suatu asumsi kritis dari model regresi linier klasik adalah bahwa gangguan (u_i) semuanya mempunyai varian yang sama, jika asumsi ini tidak terpenuhi akan terjadi heteroskedastisitas.

Konsekwensi sebagai akibat adanya heteroskedastisitas, maka pemerkiraan OLS masih tetap tidak bias dan konsisten. Akan tetapi tidak lagi efisien baik untuk sampel kecil maupun untuk sampel besar, karena variannya tidak minimum.

Pendeteksian adanya heteroskedastisitas salah satunya dapat dilakukan dengan metode uji *park*. Uji *park* dilakukan dengan meregres logaritma residual kuadrat terhadap variabel-variabel penjelas. Perhatikan nilai t statistik, apabila signifikan berarti terdapat heteroskedastisitas. (Ibid, hal. 186)

Gambar 6.4
Statistik Durbin-Watson d



6.3.4 Uji Heteroskedastisitas :

Hasil uji *Park* dapat dilihat pada tabel dibawah ini

Tabel 6.4

Hasil uji *park*

Dependent Variable: RESID2
Method: Least Squares
Date: 07/26/06 Time: 14:59
Sample: 1986 2003
Included observations: 18

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.456508	0.657908	-0.693878	0.4991
LOG(X1)	0.095096	0.121683	0.781501	0.4475
LOG(X2)	-0.032210	0.066298	-0.485834	0.6346
LOG(X3)	-0.055079	0.040575	-1.357461	0.1961
R-squared	0.222685	Mean dependent var		0.033452
Adjusted R-squared	0.056118	S.D. dependent var		0.039741
S.E. of regression	0.038610	Akaike info criterion		-3.477475
Sum squared resid	0.020870	Schwarz criterion		-3.279614
Log likelihood	35.29727	F-statistic		1.336907
Durbin-Watson stat	2.254596	Prob(F-statistic)		0.302260

Dari hasil regresi menunjukkan bahwa variable independen log x1, log x2, dan log x3 secara statistik tidak signifikan mempengaruhi residual kuadrat pada tingkat $\alpha = 5\%$. Kesimpulannya hasil regresi tidak mengandung masalah heteroskedastisitas.