

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk mendeskripsikan kemampuan metode regresi kuantil dalam mengatasi pelanggaran asumsi klasik. Asumsi klasik yang dilanggar dalam penelitian ini adalah varian *error* non homogen atau heteroskedastisitas. Untuk mencapai tujuan ini, data simulasi dihasilkan dengan mendesain data pada distribusi tertentu. Penelitian ini melakukan perbandingan antara model yang dihasilkan dari penggunaan metode kuadrat terkecil dan metode regresi kuantil pada data simulasi yang sama. Konsistensi kedua metode tersebut dibandingkan dengan melakukan simulasi juga. Penelitian ini membuktikan bahwa metode regresi kuantil memiliki nilai standar error, lebar selang dan MSE yang lebih kecil daripada nilai pada metode kuadrat terkecil. Dengan demikian dapat disimpulkan bahwa metode regresi kuantil dapat menyelesaikan masalah heteroskedastisitas dan menghasilkan model yang lebih baik daripada metode kuadrat terkecil. Dan juga metode kuadrat terkecil tidak mampu menyelesaikan masalah heteroskedastisitas.

Kata Kunci : Heteroskedastisitas, metode kuadrat terkecil, metode regresi kuantil

