

ABSTRACT

ANALYSIS OF BEHAVIOR PATTERNS INFLATION OF CPI BEFORE AND AFTER EID (ARIMA APPROACH)

By

Puspa Ayu

Inflation is an increasing trend of price levels in general and occurs continuously. Based on the research of Bank Indonesia (2014) and Arini (2012) seasonal factor is one factor in the increase in inflation, one of which is the Eid. The purpose of this study was to determine the influence of Eid on the inflation rate, behavior patterns and forecasting CPI inflation, so that the relevant agencies can carry out policies so that inflation can be controlled seasonal. Hypothesis testing is done by using the seasonal index to see the great influence and behavior patterns of inflation and for forecasting we used SARIMA and ARIMA approach and then to Seasonal Adjustment as well as to do with the method of decomposition X-13 ARIMA.

The results showed that the influence of Eid on inflation that's equal to 0, 52% and there is a pattern of behavior of inflation which, inflationary experience movement rise when a month before Eid ($h-1$) and decreases when a month after the feast eid ($h+1$). In addition to forecasting using seasonal adjustment becomes more accurate forecasting yield forecasting due to the relatively small residual done without seasonal adjustment process.

Keywords: Inflation (CPI), the Consumer Price Index, Eid, ARIMA, SARIMA, Seasonal Adjustment, decomposition X-13.

ABSTRAK

ANALISIS POLA PERILAKU INFLASI IHK SEBELUM DAN SETELAH HARI RAYA IDUL FITRI (PENDEKATAN ARIMA)

Oleh

Puspa Ayu

Inflasi merupakan kecenderungan meningkatnya tingkat harga secara umum dan terjadi secara terus-menerus. Berdasarkan penelitian Bank Indonesia (2014) dan Arini (2012) faktor musiman merupakan salah satu faktor terjadinya peningkatan inflasi, salah satunya adalah Hari Raya Idul Fitri. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui besar pengaruh hari raya Idul Fitri terhadap tingkat inflasi, pola perilaku inflasi dan peramalan IHK, sehingga instansi terkait dapat melakukan kebijakan agar inflasi musiman dapat dikendalikan. Pengujian hipotesis dilakukan dengan menggunakan metode Indeks musiman untuk melihat besar pengaruh dan pola perilaku inflasi sedangkan untuk peramalan menggunakan pendekatan ARIMA dan SARIMA serta untuk *Seasonal Adjustment* dilakukan dengan metode dekomposisi X-13 ARIMA.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa adanya pengaruh hari raya idul fitri terhadap inflasi yaitu sebesar 0,52% dan terdapat pola perilaku inflasi dimana, inflasi mengalami pergerakan kenaikan ketika satu bulan sebelum hari raya idul fitri ($h-1$) dan menurun ketika satu bulan setelah hari raya idul fitri ($h+1$). Selain itu untuk peramalan, dengan menggunakan *seasonal adjustment* peramalan menjadi lebih akurat dikarenakan menghasilkan peramalan dengan residual yang cenderung lebih kecil dibandingkan tanpa dilakukan proses *seasonal adjustment*.

Kata kunci : Inflasi (IHK), Indeks Harga Konsumen, Hari Raya Idul Fitri, ARIMA, SARIMA, Seasonal adjustment, Dekomposisi X-13,