

ABSTRACT

Stationarity Test About Inflation Data by Applying Phillips-Perron Method in Considering OLS Models

By

Ruth Pebriana Girsang

Time series data is data collected from time to time to depict an growth or tendency of circumstance or event. Time series analysis use stationary time series data. There are three way use to estimate data which stationary that is see the trend data in graph, using coefficient and correlogram ACF dan PACF and unit roots test. Phillips-Perron method is represent one of method to do unit root test. Stationary time series if mean constant and variance constant in long time. This research aim to test the stationarity inflation data Bandar Lampung City to use Phillips-Perron method and determine model use the OLS (Ordinary Least Square).

As for research result obtained that plot data difficult to know the stationary time series with the coefficient and correlogram ACF dan PACF and also Phillips-Perron Method of inflation data Bandar Lampung City to represent stationary time series and OLS model is $Y_t = -0.506681Y_{t-1} + e_t$

ABSTRAK

UJI KESTASIONERAN MENGENAI DATA INFLASI DENGAN MENERAPKAN METODE *PHILLIPS-PERRON* DALAM MENENTUKAN MODEL OLS

Oleh

RUTH PEBRIANA GIRSANG

Data deret waktu adalah data yang dikumpulkan dari waktu ke waktu untuk menggambarkan suatu perkembangan atau kecenderungan keadaan atau peristiwa. Data yang digunakan dalam analisis data deret waktu adalah data yang stasioner. Terdapat tiga cara yang digunakan untuk menduga data yang stasioner, yaitu melihat tren data dalam grafik, menggunakan koefisien dan korelogram ACF dan PACF dan uji akar-akar unit. Metode Phillips Perron merupakan salah satu metode untuk melakukan uji akar unit. Data yang stasioner jika rata-rata dan variansnya konstan disepanjang waktu. Penelitian ini bertujuan untuk menguji kestasioneran Data Inflasi Kota Bandar Lampung menggunakan metode Phillips-Perron dan menentukan model menggunakan OLS (Ordinary Least Square).

Adapun hasil penelitian yang diperoleh bahwa pada plot data sulit untuk mengetahui data stasioner, dengan koefisien dan korelogram ACF dan PACF serta metode Phillips-Perron Data Inflasi Kota Bandar Lampung merupakan data yang stasioner dan model OLSnya adalah $Y_t = -0.506681Y_{t-1} + e_t$