

ABSTRACT

ANALYZED FORECASTING DATA TIME SERIES PERIODIC USING VECTOR AUTOREGRESSIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE (VARIMA)

(Study in Case Data Inflation Level in Indonesia and BI Rate)

By

RENDI RINALDY

This research aimed to forecast inflation level in Indonesia and BI Rate using VARIMA model. The result showed that VARIMA (1,1,2) is the best model indicates that each of 4,94% inflation level then BI rate had passed 0,145%.

Keywords: Forecasting, VARMA Model, VARIMA Model.

ABSTRAK

ANALISIS PERAMALAN DATA RUNTUN WAKTU MENGGUNAKAN VECTOR AUTOREGRESSIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE (VARIMA) (Studi Kasus Data Tingkat Inflasi Indonesia dan BI Rate)

Oleh

RENDI RINALDY

Penelitian ini bertujuan untuk meramalkan tingkat inflasi di Indonesia dan BI rate dengan menggunakan model VARIMA. Hasil memperlihatkan bahwa model VARIMA (1,1,2) adalah model terbaik yang menunjukkan bahwa setiap kenaikan 4,94% tingkat inflasi maka BI rate mengalami kenaikan 0,145%.

Kata kunci: Peramalan, Model VARMA, Model VARIMA.