

ABSTRACT

METHOD OF FORECASTING USING CALENDAR VARIATION MODEL

Oleh

Karindha Feka Ayu

The aim of this study is to find the best model to forecast the inflation in Indonesia. The model used for this study is calendar variation model. Calendar variation model is technique that combines ARIMA modeling and *dummy* regression. Calendar variation is a cyclical pattern with varying periods due to different calendar date position for each year. The best model choose based on the criteria of Schwarz Bayesian Criterion (SBC). From the analysis the best model is ARIMA (1,0,0) $D_t D_{t-1}$ is the best model to forecast the number of inflation in Indonesia in the future.

Keywords : ARIMA, *Dummy regression*, Calendar Variation Model , Forecasting

ABSTRAK

METODE PERAMALAN MENGGUNAKAN MODEL VARIASI KALENDER

Oleh

Karindha Feka Ayu

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mendapatkan model terbaik untuk meramalkan jumlah inflasi di Indonesia. Model yang digunakan dalam penelitian ini adalah model variasi kalender. Model variasi kalender merupakan teknik pemodelan yang mengkombinasikan model ARIMA dan model regresi *Dummy*. Variasi kalender merupakan pola berulang dengan panjang periode yang bervariasi akibat pengaruh penanggalan kalender yang berbeda-beda setiap tahunnya. Model terbaik dipilih berdasarkan *Schwarz Bayesian Criteria* (SBC). Dari hasil analisa didapat model terbaik yaitu ARIMA (1,0,0) $D_t D_{t-1}$ yang dapat digunakan untuk meramalkan jumlah inflasi di Indonesia pada masa yang akan datang.

Kata kunci: ARIMA, Regresi *Dummy*, model variasi kalender , Peramalan