

ABSTRACT

FORECSTING DATA TIME SERIES USING VECTOR AUTOREGRESSIVE (VAR)

By

CITRA ANGGRANI PUTRI

Inflation and BI Rate is an instrument and often seen as divorce progression of the economic progress of a country. Inflastion and BI Rate is a multivariate times series that show activity for a peroid. One method to analyze multivariate time series is Vector Autoregressive (VAR). VAR method is asimultaneus equation model has several endogeneuous variables. This research uses secondary data of inflations and BI Rate on period January 2011 to May 2017. The VAR model acquired is a model VAR(2), with parameters estimated using the Ordinar Least Square. The selection model VAR(2) is based on the smallest value of AIC 1.857617.

Key words: Time Series Multivariate, Forecasting, Vector Autoregressive(VAR)

ABSTRAK

PERAMALAN DATA DERET WAKTU DENGAN MENGGUNAKAN METODE VECTOR AUTOREGRESSIVE (VAR)

Oleh

CITRA ANGGRAINI PUTRI

Inflasi dan BI Rate adalah instrumen ekonomi yang sering dilihat sebagai perkembangan ekonomi suatu negara. Inlasi dan BI Rate adalah data deret waktu multivariat yang menunjukkan aktivitas untuk periode tertentu. Salah satu untuk menganalisis deret waktu multivariat adalah metode Vector Autoregressive (VAR). Metode VAR adalah suatu model persamaan simultan yang memiliki beberapa variabel endogen. Pada penelitian ini data yang digunakan adalah data sekunder dari inflasi dan BI rate pada periode januari 2011 hingga mei 2017. Model VAR yang didapat adalah model VAR (2), dengan estimasi parameter menggunakan Metode Kuadrat Terkecil. Pemilihan model VAR (2) didasarkan pada nilai AIC yang terkecil yaitu 1.857617 .

Kata Kunci: Deret Waktu Multivariat, Peramalan, Vector Autoregressive (VAR)