

## **ABSTRAK**

### **PERAMALAN DATA DERET WAKTU DENGAN *VECTOR ERROR CORRECTION MODEL* (VECM)**

**Oleh**

**INAS KHALISHAH**

*Vector Error Correction Model* (VECM) adalah analisis yang dapat digunakan untuk melakukan peramalan apabila pada suatu data deret waktu terdapat hubungan kointegrasi dan data stasioner pada *first difference*. Penelitian ini menggunakan data inflasi, suku bunga, dan jumlah uang beredar Indonesia. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui nilai peramalan menggunakan *Vector Error Correction Model* (VECM). Hasil dari penelitian ini merupakan peramalan data inflasi pada bulan Juli 2023 yang memiliki nilai 3,2%, suku bunga 5,6%, dan jumlah uang beredar 865396 Milyar Rupiah.

**Keywords** : VECM, VAR, Stasioner, Kointegrasi, Inflasi, Suku Bunga, Jumlah Uang Beredar.

## **ABSTRACT**

### **FORECASTING TIME SERIES DATA WITH *VECTOR ERROR CORRECTION MODEL* (VECM)**

**By**

**INAS KHALISHAH**

Vector Error Correction Model (VECM) is an analysis that can be used for forecasting if there is a cointegration relationship in a time series data and the data is stationary in the first difference. This study uses data on inflation, interest rates, and money supply in Indonesia. The purpose of this study is to determine the value of forecasting using the Vector Error Correction Model (VECM). The results of this study are forecasting inflation data in July 2023 which has a value of 3.2%, interest rates of 5.6%, and money supply of 865396 billion Rupiah.

**Keywords** : VECM, VAR, Stationer, Cointegration, Inflation, Interest Rates, Money Supply.