

PENERAPAN METODE ARIMA ENSEMBEL PADA PERAMALAN INFLASI DI PROVINSI KALIMANTAN TIMUR

www.itk.ac.id

Nama Mahasiswa : Hanna Ashfia
NIM : 02161012
Dosen Pembimbing Utama : Primadina Hasanah, S.Si., M.Sc
Dosen Pembimbing Pendamping : Nashrul Millah, S.Si., M.Si

ABSTRAK

Inflasi merupakan suatu masalah yang serius mengenai kestabilan ekonomi suatu negara. Perkembangan inflasi yang terus-menerus mengalami peningkatan menjadi hambatan pada pertumbuhan ekonomi. Ketidakstabilan inflasi dari tahun ke tahun di suatu daerah akan menyulitkan bank sentral maupun pemerintah dalam menentukan kebijakan moneter. Laju inflasi yang tinggi di suatu daerah dan cenderung tidak stabil dapat menimbulkan dampak buruk bagi perekonomian daerah tersebut. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah ARIMA Ensemble dari penggabungan hasil ramalan beberapa model ARIMA dengan langkah *averaging* dan *stacking*. Data yang digunakan adalah data inflasi periode Januari 2015 – Februari 2020. Hasil penelitian menunjukkan bahwa model ARIMA Ensemble terbaik yaitu *averaging* dengan nilai RMSE terkecil dan diperoleh model $Z_t = \frac{1}{3} \sum_{i=1}^3 Z_t^{(i)}$ dimana $Z_t^{(1)}$, $Z_t^{(2)}$ dan $Z_t^{(3)}$ merupakan nilai peramalan dari ARIMA (0,0,3), ARIMA (2,0,3), dan ARIMA (3,0,3).

Kata kunci : ARIMA, ARIMA Ensemble, Inflasi.

www.itk.ac.id