

BAB 1

PENDAHULUAN

www.itk.ac.id

Bab ini memuat latar belakang, perumusan masalah, tujuan penelitian, manfaat penelitian dan kerangka penelitian.

1.1 Latar Belakang

Sejalan dengan semakin kompleksnya dunia usaha, maka kebutuhan untuk memahami masa depan yang didasarkan pada kerangka pikir yang rasional semakin berkembang pesat. Oleh karena itu, peramalan mempunyai posisi yang sangat strategis dalam proses administrasi usaha, terutama berkaitan dengan proses pengambilan keputusan. Pemerintah membutuhkan peramalan tentang kondisi ekonomi seperti meramalkan inflasi di suatu negara untuk masa-masa yang akan datang berdasarkan pengetahuan akan tren yang ada atau perlu untuk menemukan suatu kebijakan nasional yang dapat mensejahterakan rakyatnya (Salamah dkk, 2003).

Dalam bidang ekonomi, inflasi sangat berperan penting. Inflasi adalah proses kenaikan harga-harga umum secara terus menerus. Kejadian inflasi akan mengakibatkan menurunnya daya beli masyarakat. Hal ini terjadi dikarenakan dalam inflasi akan terjadi penurunan tingkat pendapatan. Laju inflasi yang rendah dan stabil merupakan tujuan utama dari pengambil kebijakan ekonomi. Laju inflasi tinggi dan biasanya juga cenderung tidak stabil dapat menimbulkan dampak buruk bagi perekonomian. Oleh karena itu, baik pemerintah maupun bank sentral di negara mana pun berusaha untuk mencapai laju inflasi yang rendah dan stabil (Bambang dan Aristanti, 2007).

Perubahan inflasi dipengaruhi oleh beberapa faktor. Menurut (Henly, 2014) yang secara garis besar dibagi menjadi dua bagian yaitu tarikan permintaan atau *demand pull inflation* dan desakan biaya atau *cost push inflation*. Faktor lain yang dapat mempengaruhi inflasi yaitu ekspor. Ekspor ditentukan oleh beberapa faktor yang akan menentukan kemampuan negara pengekspor. Beberapa faktor tersebut antara lain adalah daya saing di pasaran luar negeri, keadaan ekonomi di negara-

negara lain, kebijakan proteksi di negara luar, dan kurs valuta asing (Sukirno, 2004).

Penelitian mengenai inflasi daerah sangat penting dilakukan. Ketidakstabilan inflasi dari tahun ke tahun di suatu daerah akan menyulitkan bank sentral maupun pemerintah dalam menentukan kebijakan moneter. Menurut BPS kaltim, inflasi di Provinsi Kalimantan Timur dipengaruhi oleh 3 kota yaitu Balikpapan, Samarinda dan Tarakan sebagai penyumbang inflasi yang terjadi di Kalimantan Timur. Berdasarkan hal tersebut tidak adanya kajian terkait peramalan inflasi di Kalimantan Timur maka diperlukan suatu model yang dapat digunakan untuk memprediksi nilai inflasi di masa mendatang secara cepat, mudah dan akurat sehingga bank sentral maupun pemerintah dapat menggunakannya sebagai acuan dalam menentukan kebijakan di masa mendatang.

Dalam penelitian ini metode yang digunakan untuk peramalan adalah metode ARIMA Ensemble. Menurut (Aswi dan Sukarna, 2006) Metode ARIMA dikembangkan oleh *George E.P Box* dan *Gilym M. Jenkins*. Metode ARIMA terdiri dari beberapa aspek yaitu aspek *Autoregressive (AR)*, *Moving Average (MA)*, *Autoregressive Moving Average (ARMA)* dan *Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)*. Setelah model ARIMA diperoleh akan dilakukan peramalan. Kemudian hasil dari peramalan tersebut digabungkan dan diperoleh hasil peramalan yang baru.

Perkembangan pemodelan di bidang peramalan deret waktu menunjukkan bahwa akurasi peramalan akan meningkat jika dihasilkan dari penggabungan beberapa model dengan kombinasi linier daripada memilih satu model terbaik. Metode penggabungan multi-model sering disebut dengan pendekatan ensemble. ARIMA ensemble merupakan metode penggabungan hasil ramalan dari beberapa model ARIMA. Pembentukan ARIMA ensemble terdiri dari dua langkah. Langkah pertama yaitu menciptakan anggota ensemble dari model ARIMA yang terbentuk dengan menggunakan *averaging* dan *stacking* sehingga didapatkan model dan hasil ramalan ARIMA ensemble (Palmer dan Leutbecher, 2008).

Penggabungan model ARIMA Ensemble memiliki kualitas yang baik, yaitu mampu menghasilkan peramalan yang lebih baik daripada model ARIMA tunggal. Hasil peramalan penggabungan model ini bersifat lebih konsisten dan lebih dapat dipercaya keandalannya dalam peramalan (Subagyo dkk, 2012).

Terdapat penelitian terdahulu yang menjadi acuan dalam penelitian ini diantaranya yaitu penelitian Silfiani (2012) yang meramalkan inflasi di Indonesia dengan menggunakan metode perbandingan akurasi ARIMA ensemble dan Hasniah dkk (2016) menggunakan metode ARIMA ensemble untuk meramalkan Indeks Harga Konsumen (IHK). Berdasarkan uraian diatas maka penulis mengajukan tugas akhir mengenai metode ARIMA Ensemble dengan judul “Penerapan Metode ARIMA Ensemble pada Peramalan Inflasi di Provinsi Kalimantan Timur”.

1.2 Perumusan Masalah

Berdasarkan latar belakang yang telah dijelaskan, rumusan masalah pada penelitian ini sebagai berikut:

1. Bagaimana model ARIMA terbaik untuk meramalkan inflasi di Provinsi Kalimantan Timur?
2. Bagaimana model ARIMA Ensemble terbaik untuk meramalkan inflasi di Provinsi Kalimantan Timur?

1.3 Tujuan Penelitian

Tujuan dari penelitian ini antara lain:

1. Menentukan model ARIMA terbaik untuk meramalkan inflasi di Provinsi Kalimantan Timur.
2. Menentukan model ARIMA Ensemble terbaik untuk meramalkan inflasi di Provinsi Kalimantan Timur.

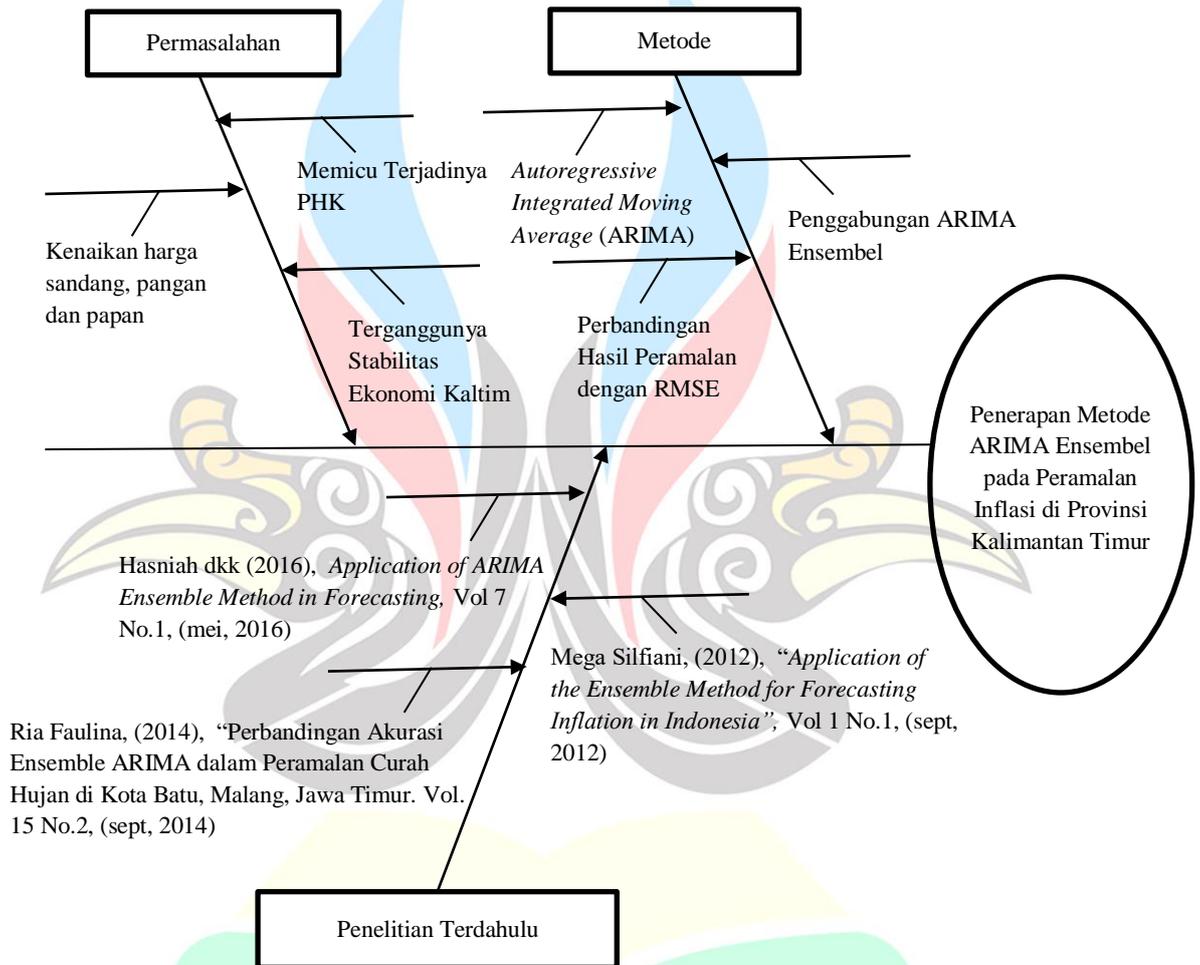
1.4 Manfaat Penelitian

Manfaat dalam penelitian ini adalah sebagai berikut:

1. Memperoleh wawasan dan informasi bagi pemerintah provinsi dalam menentukan kebijakan yang tepat bagi permasalahan ekonomi di Kalimantan Timur.
2. Memperoleh pengetahuan untuk menerapkan metode ARIMA Ensemble dalam meramalkan masalah inflasi.
3. Sebagai referensi bagi pemerintah provinsi untuk bahan pertimbangan menyusun proyeksi inflasi dalam kebijakan moneter.

1.5 Kerangka Pemikiran Penelitian

Kerangka penelitian berisi permasalahan yang ada, metode yang digunakan, penelitian terdahulu dan output yang diinginkan. Tujuan adanya kerangka penelitian ini untuk memberikan gambaran kepada pembaca mengenai penelitian yang dikerjakan.



Gambar 1.1 Kerangka Pemikiran Penelitian