

BAB V

PENUTUP

5.1 Kesimpulan

1. Model *Markov Switching Autoregressive* (MSAR) yang terbaik dalam memodelkan inflasi DKI Jakarta pada periode Januari 2017 hingga Desember 2021 adalah MS(2)AR(1), dengan bentuk model sebagai berikut:

$$(z_t - \mu_{s_t}) = 0,319530(z_{t-1} - \mu_{s_{t-1}}) + \epsilon_t$$

dengan

$$\mu_{s_t} = \begin{cases} 1,164987, & \text{jika } s_t = 1 \\ 1,019772, & \text{jika } s_t = 2. \end{cases}$$

Namun dalam penguannya, hasil dari model diatas perlu dilakukan transformasi kembali ke bentuk y_t sebagai berikut.

$$y_t = z_t^2 - 1$$

2. Peluang inflasi DKI Jakarta saat t untuk bertahan pada kondisi peningkatan, sebesar 0,729880. Kemudian, peluang inflasi DKI Jakarta mengalami perubahan kondisi peningkatan ke kondisi penurunan yaitu sebesar 0,270120. Peluang inflasi DKI Jakarta saat t untuk bertahan

pada kondisi penurunan sebesar 0,732562 dan peluang transisi dari kondisi penurunan ke kondisi peningkatan sebesar 0,267438.

3. Rata-rata lama durasi inflasi DKI Jakarta mengalami kondisi peningkatan yaitu selama 3,702058 bulan atau kurang lebih selama 4 bulan dan rata-rata lama durasi inflasi DKI Jakarta mengalami kondisi penurunan, yaitu selama 3,200829 bulan atau kurang lebih selama 3 bulan.

5.2 Saran

Penelitian ini memodelkan inflasi DKI Jakarta dengan menggunakan metode *markov switching autoregressive* (MSAR), untuk pembahasan lebih lanjut dapat diterapkan dengan menggabungkan *markov switching* dengan metode lain dengan harapan menghasilkan model yang lebih optimal.

