

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Dari bab hasil dan pembahasan pada tugas akhir ini dengan menggunakan metode ARFIMAX dapat disimpulkan, Model ARFIMAX dengan orde $(1, 0.4801694, 1)$ merupakan model terbaik. Dari model ini, dapat dikatakan bahwa inflasi dipengaruhi oleh nilai tukar rupiah terhadap USD, nilai inflasi pada satu periode sebelumnya, serta satu nilai residual sebelumnya. Adapun bentuk persamaan model ARFIMAX $(1, 0.4801694, 1)$ adalah sebagai berikut.

$$X_t = 0.002382134Y_{1,t} + \frac{(1 - 0.321115397B)}{(1 - 0.856338350B)(1 - B)^{0.4801694}} \varepsilon_t.$$

Berdasarkan perhitungan tingkat keakurasian model, nilai MAPE pada pemodelan data inflasi di Indonesia dengan metode ARFIMAX memiliki nilai lebih kecil dari model ARFIMA yaitu sebesar 10.03669%. Dengan demikian, dapat disimpulkan bahwa model ARFIMA dengan penambahan variabel nilai tukar rupiah terhadap USD memiliki tingkat keakurasian yang baik dalam memodelkan data deret waktu dengan karakteristik *long memory*.

5.2 Saran

Berdasarkan hasil penelitian yang telah diperoleh, peneliti menyarankan kepada peneliti selanjutnya agar dapat mengembangkan penelitian ini dengan menambahkan variabel eksternal lainnya yang berpotensi dapat memengaruhi inflasi di Indonesia seperti harga komoditas internasional, suku bunga acuan, jumlah uang beredar, maupun faktor kebijakan fiskal dan moneter.

