

BAB V

PENUTUP

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil dan pembahasan sebelumnya, diperoleh kesimpulan sebagai berikut:

1. Model TV-VAR yang dibangun mampu menangkap hubungan dinamis antar variabel ISSI, nilai tukar, inflasi, dan neraca perdagangan. Inflasi menunjukkan persistensi paling tinggi dan relatif stabil, tercermin dari dominannya pengaruh lag dirinya sendiri sepanjang periode pengamatan. ISSI juga dipengaruhi kuat oleh lag dirinya sendiri, namun pengaruh tersebut melemah sekitar tahun 2020, yang mengindikasikan meningkatnya peran faktor lain. Sebaliknya, neraca perdagangan lebih banyak dipengaruhi oleh nilai tukar dan faktor eksternal dengan hubungan yang tidak stabil, sedangkan nilai tukar menunjukkan fluktuasi koefisien yang tajam sehingga menjadi variabel yang paling sensitif terhadap guncangan.
2. Model hybrid TV-VAR dan Neural Network menunjukkan kinerja yang lebih baik dibandingkan TV-VAR pada hampir seluruh metrik evaluasi, yang menandakan kemampuannya dalam menangkap pola nonlinier yang

tidak terakomodasi oleh TV-VAR. Meskipun nilai Mean Squared Error pada variabel neraca perdagangan relatif lebih tinggi akibat sensitivitas terhadap outlier, metrik lainnya tetap mengindikasikan peningkatan kinerja. Secara keseluruhan, hasil ini menegaskan bahwa pendekatan hybrid mampu meningkatkan akurasi prediksi dan menjadi alternatif yang efektif untuk memodelkan dinamika makroekonomi yang kompleks dan nonlinier.

5.2 Saran

Adapun saran untuk penelitian selanjutnya yaitu mencoba arsitektur dari *Neural Network* lainnya seperti *Convolutional Neural Network*, *Probabilistic Neural Network* untuk diintegrasikan dengan model *TV-VAR*. Kemudian juga menggunakan pendekatan alternatif lainnya terutama untuk mengatasi jika adanya *outlier* atau data yang sangat berfluktuasi. Kemudian mempertimbangkan variabel atau faktor lainnya agar dapat mendapatkan hubungan yang lebih komprehensif.