

ABSTRACT

Title : Data Modeling with Time Series Intervention Analysis in CPI Ambon City data Year 1999-2009

Models of intervention is a time series model that can be used to model and predict data containing interference or intervention from both external and internal factors. There are two main functions used in the model of intervention, namely the step function and pulse function. This study investigated the theoretical and applied knowledge about intervention analysis. Theoretical studies conducted to obtain the proper procedure in the modeling intervention, subsequently, applied studies conducted for the Consumer Price Index data model with the intervention variable of fuel price increases that occurred in October 2005 (step function). Results analysis showed that the effect caused by incidents such interventions have a positive or in other words caused a significant increase in the CPI value.

Keywords : Intervention Analysis, ARIMA, IHK.

ABSTRAK

Judul Tesis : Pemodelan Data *Time Series* dengan Analisis Intervensi pada data IHK Kota Ambon Tahun 1999-2009

Model intervensi adalah suatu model *time series* yang dapat digunakan untuk memodelkan dan meramalkan data yang mengandung gangguan atau intervensi baik dari faktor eksternal maupun internal. Ada dua fungsi utama yang digunakan dalam model intervensi, yaitu fungsi *step* dan *pulse*. Penelitian ini mengkaji secara teoritis dan terapan tentang analisis intervensi. Kajian teoritis dilakukan untuk mendapatkan prosedur yang tepat dalam pemodelan intervensi, selanjutnya, kajian terapan dilakukan untuk memodelkan data Indeks Harga Konsumen dengan variabel intervensi kenaikan harga BBM yang terjadi pada Oktober 2005 (fungsi *step*). Hasil analisis yang dilakukan menunjukkan bahwa pengaruh yang ditimbulkan oleh kejadian intervensi tersebut berpengaruh positif atau dengan kata lain menyebabkan peningkatan nilai IHK secara signifikan.

Kata Kunci : Analisis Intervensi, ARIMA, IHK.