

ABSTRAK

Siska Purnama, NIM 4162230009 (2016). Peramalan Nilai Ekspor dan Impor Indonesia Menggunakan Metode ARIMA *Box-Jenkins*.

Nilai ekspor dan impor memiliki pengaruh yang signifikan terhadap perekonomian di Indonesia, sehingga nilai ekspor dan impor di suatu negara harus dikendalikan dengan menyusun strategi yang tepat. Strategi tersebut dapat dibentuk dengan mengetahui kondisi pasar ekonomi yakni dengan peramalan. Pada penelitian ini, metode peramalan yang digunakan untuk meramalkan nilai ekspor dan impor Indonesia adalah metode ARIMA *Box-Jenkins*. Data yang digunakan adalah data nilai ekspor dan nilai impor Indonesia yaitu dari Januari 2010 sampai Juni 2020. Model ARIMA terbaik untuk peramalan adalah model yang memenuhi syarat signifikansi parameter, residual *white noise* dan berdistribusi normal serta memiliki nilai AIC terkecil. Berdasarkan penelitian yang telah dilakukan, diperoleh model terbaik untuk peramalan nilai ekspor Indonesia adalah model ARIMA (1,1,12) dengan nilai AIC sebesar 16,61 dan nilai MAPE *out sample* untuk kalibrasi model sebesar 5,68%. Model ARIMA terbaik untuk peramalan nilai impor Indonesia adalah model ARIMA (12,1,0) dengan nilai AIC sebesar 37,29 dan nilai MAPE *out sample* untuk kalibrasi model sebesar 4,7%. Sehingga didapatkanlah hasil peramalan nilai ekspor dan nilai impor Indonesia untuk setahun mendatang.

Kata kunci: Ekspor, Impor, ARIMA, AIC, MAPE

