

PENGARUH KEMERUPAN INDEKS HARGA PENGGUNA AMERIKA
TERHADAP INDEKS HARGA PENGGUNA MALAYSIA :
APLIKASI MODEL ARMA-MEUKA

CHRISTINA A/P MICHEAL

FAKULTI PENGEHUSAN DAN EKONOMI
UNIVERSITI MALAYSIA TERENGGANU
2010

**PENGARUH KEMERUAPAN INDEKS HARGA
PENGGUNA AMERIKA SYARIKAT TERHADAP
KESTABILAN INDEKS HARGA PENGGUNA
MALAYSIA: APLIKASI MODEL ARMA-ARIMA**

**CHRISTINA A/P MICHEAL
SM EKONOMI (SUMBER ALAM)**

**PROJEK ILMIAH INI DIKEMUKAKAN BAGI
MEMENUHI SEBAHAGIAN DARIPADA SYARAT
PENGAJIAN**

**FAKULTI PENGURUSAN DAN EKONOMI
UNIVERSITI MALAYSIA TERENGGANU**

2010

PENAKUAN

Saya akui Kertas Projek (EKN4998) ini adalah hasil kajian saya sendiri kecuali sumber-sumber lain yang telah saya jelaskan rujukannya.

13 April 2010



.....
CHRISTINA A/P MICHEAL
UK15181

DECLARATION

I hereby declare that this project paper (EKN 4998) is the result of my own investigation and findings, except where otherwise stated.

13th April 2010



.....
CHRISTINA D/O MICHEAL
UK15181

PENGHARGAAN

Saya bersyukur kerana berjaya menyiapkan laporan kajian ini dengan jayanya. Banyak pengorbanan dan komitmen yang bersungguh-sungguh yang diperlukan bagi memenuhi keperluan program ini memandangkan laporan kajian ini adalah syarat bagi bergraduasi.

Setinggi-tinggi penghargaan ingin saya tujukan kepada penyelia kertas projek Encik Nanthakumar Loganathan sebagai mentor utama dalam menyiapkan kertas projek kajian ini. Beliau banyak berkorban masa dan tenaga dalam memberi nasihat dan tunjuk ajar serta dorongan kepada saya dalam usaha menjayakan dan menyiapkan laporan kajian ini. Peranan penting yang dimainkan oleh beliau dalam memberi tunjuk ajar serta dorongan yang membina amat saya hargai.

Ucapan terima kasih ingin saya kalungkan kepada para pensyarah Jabatan Ekonomi, khususnya yang telah banyak membantu saya secara langsung mahupun tidak langsung dalam menyiapkan kajian ini. Saya ingin mengucapkan ribuan terima kasih kepada pensyarah-pensyarah memberikan ilmu dan pengetahuan sepanjang pengajian saya di Universiti Malaysia Terengganu ini. Sesungguhnya segala tunjuk ajar kalian akan saya gunakan sebagai panduan untuk meneruskan kehidupan kelak yang lebih mencabar.

Teristimewa saya tujukan kepada ibu saya iaitu, Puan Arputhamary dan juga adik-beradik saya kerana berkat dorongan dan sokongan yang tidak putus-putus mengharap kejayaan saya dalam menyiapkan kajian ini di samping menamatkan pengajian dengan jayanya. Akhir sekali, buat rakan-rakan seperjuangan yang turut membantu dan bersama-sama berusaha memenuhi kehendak dan keperluan program. Segala kenangan manis dan duka akan saya jadikan sebagai kenangan dan akan dikenang buat selama-lamanya.

Sekian.

NAMA : CHRISTINA A/P MICHEAL

KURSUS : Ijazah Sarjana Muda Ekonomi (Sumber Alam)

E-MAIL : grace_tina87@yahoo.com

ABSTRAK

Kajian ini menganalisis kemeruapan indeks harga pengguna (IHP) Amerika Syarikat dan Malaysia bagi tempoh 30 tahun iaitu dari 1970 hingga 2008. Dalam kajian ini hanya satu pemboleh ubah iaitu indeks harga pengguna digunakan sebagai penentu insiden inflasi Amerika Syarikat dan Malaysia. Model ARIMA ataupun di kenali sebagai pendekatan Box-Jenkins digunakan dalam kajian ini bagi menentukan kesinambungan IHP Amerika Syarikat dan Malaysia. Sebelum memilih model yang sesuai, ujian punca unit telah digunakan untuk menguji kepegunan dan mengenal pasti integrasi pada setiap pemboleh ubah. Kedua, untuk mendapatkan kemeruapan yang baik, kajian ini telah mengenal pasti tahap auto-korelasi (AR) dan pergerakan rawak purata (MA) bagi keseluruhan data siri masa kajian untuk membentuk kombinasi AR dan MA yang dikenali sebagai model ARMA. Dalam kajian ini, ARIMA yang paling sesuai dipilih bagi kedua-dua negara kajian adalah bersamaan dengan ARIMA (3,1,2). Secara keseluruhan, terdapat kemeruapan di antara IHP Amerika Syarikat dan Malaysia.

Kata kunci: Kemeruapan, indeks harga pengguna, ARIMA

ABSTRACT

This study examining the United States and Malaysia consumer price index (CPI) volatility for the entire period of 30 years begin from 1970-2008. An Univariate approach has been applied to identify both countries CPI volatility. ARIMA model or well known as Box-Jenkins model has been applied in this study to generate the volatility of CPI. Before selecting an appropriate model, formal stationary tests has been applied in this study and find that, the series are stationary at level. Secondly, in order to get a good result, this study has identified the autoregressive (AR) and moving average (MA) of the entire period of the data. Therefore, the consumer price index is based on the combination of AR and MA, which known as ARMA model. Furthermore, the competing models have been thoroughly investigated when the model adequacy has been checked before the best combination of ARIMA model was selected. Thus, the best fitted ARIMA (3,1,2) for the both country has been suggested through this study. Finally, there are clear evidence of volatility between United States and Malaysia's CPI.

Keywords: Volatility, consumer price index, ARIMA