

du: 8894

1100089152

Pusat Pembelajaran Digital Sultanah Nur Zahirah (UMT)
Universiti Malaysia Terengganu.



LP 42 FPE I 2010



1100089152
Peramalan krisis kewangan masa hadapan : Sistem Mahalanobis
Taguchi (MTS) / Nur Azielia Nadia Kamal.

PUSAT PEMBELAJARAN DIGITAL SULTANAH NUR ZAHIRAH
UNIVERSITI MALAYSIA TERENGGANU (UMT)
21030 KUALA TERENGGANU

1100089152		

Lihat Sebelah

HAK MILIK
PUSAT PEMBELAJARAN DIGITAL SULTANAH NUR ZAHIRAH

PERAMALAN KRISIS KEWANGAN MASA
HADAPAN: SISTEM MAHALANOBIS TAGUCHI
(MTS)

NUR AZIELIA NADIA BT KAMAL
SM EKONOMI (SUMBER ALAM)

PROJEK ILMIAH INI DIKEMUKAKAN BAGI
MEMENUHI SEBAHAGIAN DARIPADA
SYARAT PENGAJIAN

JABATAN EKONOMI
FAKULTI PENGURUSAN DAN EKONOMI
UNIVERSITI MALAYSIA TERENGGANU
UMT

2010

PENGAKUAN

Saya akui Kertas Projek (EKN 4998 / 4999) ini adalah hasil saya sendiri kecuali sumber-sumber lain yang telah saya jelaskan rujukannya melalui senarai rujukan yang telah dilampirkan.

Tarikh :

.....

NUR AZIELIA NADIA BT KAMAL

UK 14805

DECLARATION

I hereby declare that this Project Paper (EKN 4998 / 4999) is the result of my own finding, except where otherwise stated other sources are acknowledge by giving references is appended.

Date :

.....

NUR AZIELIA NADIA BT KAMAL

UK 14805

PENGHARGAAN

Syukur kehadiran Allah S.W.T yang maha Pengasih lagi maha Penyayang dengan limpah perkenanNYA dapat menyiapkan Projek Ilmiah Tahun Akhir yang bertajuk Peramalan Krisis Kewangan Masa Hadapan: *Mahalanobis Taguchi System*.

Setinggi-tinggi penghargaan dan ucapan terima kasih yang tidak terhingga kepada penyelia kertas projek, Dr. Nur Azura Bt Sanusi atas segala bimbingan dan tunjuk ajar sewaktu sulit atau senang. Segala apa yang dicurahkan amat saya hargai. Penghargaan ini juga turut ditujukan kepada pihak Fakulti Pengurusan dan Ekonomi diatas segala pertolongan yang dihulurkan dalam memudahkan proses menyiapkan kertas projek ini.

Selain dari itu, tidak lupa penghargaan ditujukan kepada ahli keluarga saya di atas segala sokongan yang diberikan. Akhir sekali kepada semua rakan seperjuangan Sarjana Muda Ekonomi (Sumber Alam) atas segala pertolongan yang dicurahkan. Semoga dengan penghasilan kertas projek ini dapat memberikan sedikit pengetahuan kepada semua pihak.

Sekian, terima kasih.

NUR AZIELIA NADIA BT KAMAL
SARJANA MUDA EKONOMI (SUMBER ALAM)
LENGGONG PERAK DARUL RIDZUAN
NO.TEL. (H) : 013-4441432
E-MAIL : nazielia@yahoo.com

ABSTRAK

Secara umumnya, kajian ini bertujuan menganalisis kesan krisis dan kejutan di dalam ekonomi yang dialami oleh Malaysia pada waktu krisis kewangan 1997, dan juga mengkaji kesesuaian model yang digunapakai bagi peramalan krisis kewangan yang bakal terjadi pada masa hadapan. Permasalahan yang timbul dalam kajian ini adalah Malaysia tidak dapat meramal krisis kewangan yang bakal berlaku pada masa hadapan disebabkan tidak mempunyai model peramalan yang tepat. Melalui model peramalan yang tepat Malaysia sememangnya dapat bersedia untuk mengendalikan krisis tersebut dengan lebih cekap. Dengan menggunakan model *Mahalanobis Taguchi System* (MTS) permasalahan yang timbul daripada kajian ini dapat diselesaikan. Melalui pengenalpastian dua kumpulan yang akan dijadikan sampel kajian, iaitu syarikat bermasalah dan syarikat tidak bermasalah yang tersenarai di Bursa Saham Malaysia. Data diambil dari tahun 1998 hingga tahun 2000, dimana ketiga-tiga tahun yang diambil sebagai sampel sememangnya tahun yang terkesan oleh krisis kewangan pada tahun 1997. Melalui pengenalpastian kedua kumpulan tersebut, sebanyak sembilan pembolehubah digunakan dalam meramal krisis kewangan iaitu iaitu hasil (X_{i1}), untung rugi sebelum cukai (X_{i2}), susutnilai (X_{i3}), aset tetap (X_{i4}), jumlah aset jangka panjang (X_{i5}), jumlah aset (X_{i6}), jumlah liabiliti (X_{i7}), jumlah rizab (X_{i8}) dan dana pemegang saham (X_{i9}). Dengan menggunakan langkah didalam model *Mahalanobis Taguchi System* (MTS) hasilnya kesembilan pembolehubah ini sangat tepat untuk digunakan dalam membuat peramalan krisis kewangan pada masa hadapan. Melalui hasil kajian juga, kesan daripada krisis dan kejutan ekonomi dapat dianalisis dalam menentukan model peramalan yang sesuai untuk diaplikasikan kelak.

ABSTRACT

In general, this study aims to analyze the impact of the crisis and the economic shocks experienced by Malaysia during the 1997 financial crisis, and to develop a model that can be used in forecasting the financial crisis in the future. Due to the lack of early warning system, Malaysia can not predict the financial crisis that will occur in the future. Through accurate forecasting models, Malaysia able to handle the crisis effectively. Therefore, by using the Mahalanobis Taguchi System (MTS) problem statement arising from this study can be answered. In order to forecast the financial crisis, the identification of sample consists of two groups of companies which are the sound companies and trouble companies listed at Bursa Malaysia from 1998 to 2000. Through the identification of this group, a total of nine variables utilized in forecasting the financial crisis, namely earnings (Xi1), profit and loss before tax (Xi2), depreciation (Xi3), fixed assets (Xi4), total long-term assets (Xi5), total assets (Xi6), total liabilities (Xi7), total reserves (Xi8) and the shareholders funds (Xi9). By using the steps in the model of Mahalanobis Taguchi System (MTS,) the results show all the variables are accurate in making the prediction of financial crisis in the future. Through the study, the effects of the crisis and the economic shocks can be analyzed to determine the appropriate forecasting model to be applied later.