

## ABSTRAK

### PEMODELAN VECTOR AUTOREGRESSIVE DAN ANALISIS FAKTOR PENENTU PADA PREDIKSI KURS IDR-USD

Oleh

Gayuh Fikri Khusnaeli

21110024

Fluktuasi kurs Indonesia Rupiah (IDR) terhadap Dolar Amerika Serikat (USD) dapat memberikan dampak signifikan terhadap perekonomian Indonesia. Maka dari itu, perlu dilakukan analisis mengenai faktor-faktor yang mempengaruhi perubahan kurs serta prediksinya. Penelitian ini menganalisis hubungan antar variabel ekonomi serta melakukan prediksi nilai tukar berdasarkan interaksi antar variabel menggunakan model Vector Autoregressive (VAR). Data yang digunakan merupakan data sekunder bulanan dari tahun 2000 hingga 2024, mencakup variabel ekspor, impor, inflasi, BI Rate, dan kurs. Berdasarkan kriteria AIC, *lag* optimal yang dipilih adalah *lag* ke-12. Hasil uji kausalitas granger menunjukkan adanya hubungan dua arah antara kurs dengan ekspor, impor, dan BI Rate, sementara hubungan antara kurs dan inflasi tidak terbukti secara statistik. Model VAR yang dibangun menunjukkan performa yang sangat baik, dengan nilai MAPE sebesar 2,59%, RMSE sebesar 527,97, dan MAE sebesar 407,25. Hasil prediksi kurs IDR/USD tahun 2025 menunjukkan fluktuasi, dengan nilai tertinggi diperkirakan terjadi pada April sebesar 16.443,44 dan nilai terendah pada Agustus sebesar 16.036,14. Penelitian ini diharapkan dapat menjadi acuan dalam analisis makroekonomi serta perencanaan kebijakan moneter yang lebih tepat sasaran.

**Kata kunci:** IDR, Kausalitas Granger, Kurs, Lag Optimal, USD, Vector Autoregressive (VAR)