

PERAMALAN HARGA MINYAK DI INDONESIA MENGGUNAKAN METODE *AUTO REGRESSIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE (ARIMA)*

Skripsi S1 oleh: Rima Restu Ananda

Pembimbing : **Rini Rahmahdian, SE. MSE.**

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk meramalkan harga minyak di Indonesia dan diiringi oleh peramalan nilai kurs agar mendapatkan gambaran harga minyak dalam rupiah yang tepat. Regresi yang digunakan dalam penelitian ini untuk meramalkan harga minyak menggunakan metode *Auto Regressive Moving Average (ARIMA)* dan peramalan kurs dengan menggunakan metode *Generalized Auto Regressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)*. Penelitian ini menggunakan data time series, untuk variable harga minyak data yang digunakan mulai dari tahun Januari 1986 – Desember 2015 dan variable kurs mulai tahun Januari 2010 – Desember 2015. Hasil dari penelitian ini berdasarkan hasil estimasi ARIMA, model terbaik dalam meramalkan harga minyak adalah ARIMA (4,1,4), sedangkan untuk variable kurs model terbaik untuk meramalkan nilai kurs adalah GARCH (1,2).

Kata Kunci : Harga Minyak, Kurs, ARIMA, GARCH.