ANALISIS METODE VECTOR AUTOREGRESSIVE (VAR) TERHADAP DATA KURS MATA UANG DAN HARGA SAHAM

Haykal Dwi Purnomo[1*], Nusyirwan[2], Subian Saidi[3], dan Netti Herawati[4]

[1,2,3,4]Jurusan Matematika, Fakultas MIPA, Universitas Lampung
Jl. Prof. Dr. Soemantri Brodjonegoro Nomor 1 Bandar Lampung 35145

[*]Email korespondensi: [1]dhaykalp@gmail.com

ABSTRAK

Metode Vector Autoregressive merupakan salah satu analisis yang digunakan pada data deret waktu yang stasioner dan tidak ada kointegrasi. Tujuan dari penelitian ini adalah menganalisis metode VAR untuk mengetahui hubungan antara nilai kurs mata uang (USD/IDR) dan harga saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk. Hasil penelitian memperlihatkan bahwa data tersebut memiliki hubungan jangka pendek yang saling memengaruhi ditunjukkan pada model VAR(1).

Kata Kunci: Stasioner, Kointegrasi ,VAR