

## ABSTRAK

Model *vector autoregressive* (VAR) merupakan suatu metode analisis data runtun waktu yang berbentuk hubungan antara variabel terikat dan variabel bebas berdasarkan nilai masa lalu. Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui model hubungan antara nilai tukar (kurs) rupiah terhadap dolar Amerika Serikat, jumlah uang beredar dan tingkat inflasi. Metode penelitian yang digunakan yaitu *vector autoregressive*. Kemudian untuk mendapatkan hasil estimasi, dilakukan pengujian stasioneritas dengan menggunakan uji *Augmented Dickey-Fuller* (ADF), transformasi *Box-Cox*, uji kointegrasi, uji stabilitas model serta uji kausalitas Granger. Data yang digunakan pada penelitian ini yaitu data runtun waktu dari tahun 2003 sampai dengan tahun 2018. Hasil estimasi didapatkan model VAR(14) serta hasil MAPE pada ketiga variabel yaitu variabel kurs sebesar 4,3700, variabel jumlah uang beredar sebesar 0,1476 dan variabel tingkat inflasi sebesar 1,8921.

**Kata Kunci:** *Vector autoregressive, runtun waktu, Augmented Dickey-Fuller, kausalitas Granger.*

