

ABSTRAK

Suatu data deret waktu biasanya dipengaruhi oleh beberapa faktor, seperti faktor trend dan faktor musiman. Data deret waktu yang dipengaruhi oleh trend dan musiman dapat dimodelkan dengan model SARIMA. Namun, model SARIMA tidak selalu menghasilkan ragam sisaan yang konstan pada data musiman yang berfluktuasi tinggi atau model yang diperoleh dipengaruhi oleh efek heteroskedastisitas. Salah satu model yang dapat mengatasi efek heteroskedastisitas adalah model ARCH/GARCH. Oleh karena itu, digunakan model ARCH/GARCH untuk mengatasi heteroskedastisitas pada data musiman. Penelitian dilakukan menggunakan data musiman yang juga memiliki fluktuasi tinggi, yaitu data jumlah kunjungan wisatawan mancanegara ke Indonesia melalui bandara Ngurah Rai Bali pada bulan Januari 2008 sampai Desember 2019. Model terbaik yang diperoleh untuk data tersebut adalah SARIMA(0,1,1)(0, 1, 1)₁₂ ARCH(1).

Kata kunci : SARIMA, ARCH, GARCH