

ABSTRAK

Dalam proses transaksi jual-beli antarnegara sering kali mengalami masalah dalam hal pembayaran karena perbedaan nilai uang yang berlaku di setiap negara. Nilai tukar dapat berubah setiap saat sesuai mekanisme pasar, oleh karena itu diperlukan prediksi nilai tukar mata uang untuk menentukan kebijakan ekonomi yang akan datang.

Untuk mengatasi kasus tersebut dibutuhkan sebuah metode peramalan. Pada kasus ini, metode yang akan digunakan adalah gabungan antara ARIMA (*Autoregressive Integrated Moving Average*) dan ANN (*Artificial Neural Network*), dimana masing-masing metode memiliki kelebihan. ARIMA digunakan untuk memodelkan *time series* linear, sedangkan ANN digunakan untuk mengatasi *time series* nonlinear.

Data histori yang akan digunakan untuk peramalan adalah data kurs IDR terhadap USD dalam rentang waktu Januari 2009 – Desember 2013. Setelah dilakukan prediksi, didapatkan hasil bahwa metode *hybrid* ARIMA dan ANN bisa diterapkan dalam peramalan kurs IDR terhadap USD.

Kata kunci: *ARIMA, ANN, Hybrid ARIMA dan ANN*