

## Abstrak

Perkembangan teknologi informasi telah membuka peluang baru di sektor investasi. Pembukaan rekening saham yang mudah membantu meningkatkan minat investasi di bursa saham Indonesia. Perbankan online menawarkan prospek investasi yang menarik, salah satunya saham PT Bank Neo Commerce Tbk (BBYB.JK). Peramalan dilakukan untuk mengetahui prediksi harga saham tersebut. Penggunaan analisis *time series* bisa membantu dalam memprediksi peramalan harga saham mendatang. Model *time series* yang digunakan dalam penelitian ini adalah model *Vector Autoregressive* (VAR) dan *Vector Autoregressive Moving Average* (VARMA), dengan melibatkan dua variabel data. Pemilihan kedua model tersebut didasarkan pada penggunaan dua variabel, yakni harga saham dan volume saham sebagai variabel kedua. Volume perdagangan saham berfungsi sebagai indikator aktivitas saham dan memberikan wawasan tentang permintaan beli dan jual saham. Metode *differencing* digunakan untuk menangani data yang tidak memiliki kestasioneran. Model dievaluasi menggunakan nilai *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE) dan *Mean Absolute Error* (MAE). Model VAR (1) dengan rasio data *training* 90% dan *testing* 10% memberikan hasil paling akurat dengan nilai MAPE 2.08% dan nilai MAE 11.04. Semakin rendah nilai MAPE dan MAE mengindikasikan hasil peramalan yang lebih akurat.

**Kata kunci :** Prediksi, Saham, *Time series*, *Differencing*, VAR, VARMA