

Abstrak

Di zaman era digitalisasi saat ini, terdapat banyak pilihan bagi masyarakat dalam menginvestasikan dana yang dimilikinya. Salah satunya adalah dengan memperjual belikan saham. Industri bank digital menjadi trend bagi masyarakat untuk berinvestasi karena memiliki prospek yang cerah di masa depan. Untuk itu diperlukan suatu peramalan dalam memprediksi harga saham agar masyarakat dapat merencanakan keputusan finansial mereka dengan matang. Pada penelitian ini PT. Bank Raya Indonesia Tbk (AGRO.JK) dipilih sebagai indeks saham yang diprediksi karena bank ini merupakan pelopor bank digital diantara bank BUMN di Indonesia. Analisis *time series* dapat dipergunakan untuk peramalan harga saham di masa yang akan datang. Terdapat dua model *time series* yang dipakai yaitu model *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA) yang bersifat *univariate* dengan variabel harga penutup dan *Vector Autoregressive Integrated Moving Average* (VARIMA) yang bersifat *multivariate* dengan variabel harga penutup dan terendah. Dengan rasio 80% data *train* dan 20% data *test*, Model ARIMA(17,1,17) menghasilkan nilai RMSE sebesar 0.0206 dan model VARIMA (9,1,1) menghasilkan nilai RMSE sebesar 0.5707.

Kata kunci: prediksi, saham, *time series*, ARIMA, VARIMA, RMSE