

**PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERBANKAN PADA
BADAN USAHA MILIK NEGARA DI BURSA EFEK
INDONESIA**

SKRIPSI

Untuk Memenuhi Salah Satu Persyaratan Mencapai
Derajat Sarjana Manajemen



Oleh:
Aqli Bernas
202110160311020

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH MALANG
2025**

LEMBAR PERSETUJUAN

SKRIPSI

**PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERBANKAN PADA
BADAN USAHA MILIK NEGARA DI BURSA EFEK
INDONESIA**

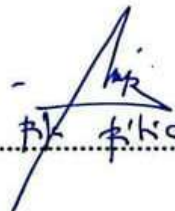
Oleh:
Aqli Bernas
202110160311020

Malang, 20 Desember 2024

Telah disetujui oleh:

Pembimbing I,

(Dewi Nurjanah, M.M.)

Pembimbing II,

(Aqli Bernas)

SKRIPSI

**PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERBANKAN
PADA BADAN USAHA MILIK NEGARA DI BURSA EFEK INDONESIA**

Oleh:

Aqli Bernas

202110160311020

Diterima dan disetujui
pada tanggal 28 Desember 2024

Pembimbing I,



Dr. Dewi Nurjannah, M.M.

Pembimbing II,



Fika Fitriyasari, S.E., M.M., Ph.D.

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis,



Prof. Dr. Idah Zuhroh, M.M.

Ketua Program Studi,



Dr. Nurul Asfiah, M.M.

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERBANKAN PADA BADAN USAHA MILIK NEGARA DI BURSA EFEK INDONESIA

Yang disiapkan dan disusun oleh:

Nama : **Aqli Bernas**

NIM : **202110160311020**

Jurusan : **Manajemen**

Telah dipertahankan di depan penguji pada tanggal 28 Desember 2024 dan dinyatakan telah memenuhi syarat untuk diterima sebagai kelengkapan guna memperoleh gelar Sarjana Manajemen pada Universitas Muhammadiyah Malang.

Susunan Tim Penguji:

Pembimbing I : **Dr. Dewi Nurjannah, M.M.**

Pembimbing II : **Fika Fitriasari, S.E., M.M., Ph.D.**

Penguji I : **Dr. M. Jihadi, M.Si.**

Penguji II : **Novi Puji Lestari, S.E., M.M.**

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis,

Ketua Program Studi,



Prof. Dr. Idah Zuhroh, M.M.

Dr. Nurul Asfiah, M.M.

1.

2.

3.

4.

PERNYATAAN ORISINALITAS

Yang bertanda tangan dibawah ini, saya:

Nama : Aqli Bernas
NIM : 202110160311020
Program studi : Manajemen
Surel : aqlibernas@webmail.umm.ac.id

Dengan ini menyatakan bahwa:

1. Skripsi ini adalah asli dan benar-benar hasil karya sendiri, baik sebagian maupun keseluruhan, bukan hasil karya orang lain dengan mengatasnamakan saya, serta bukan merupakan hasil penjiplakan (*plagiarism*) dari hasil karya orang lain;
2. Karya dan pendapat orang lain yang dijadikan sebagai bahan rujukan (referensi) dalam skripsi ini, secara tertulis dan secara jelas dicantumkan sebagai bahan/sumber acuan dengan menyebutkan nama pengarang dan dicantumkan di daftar pustaka sesuai dengan ketentuan penulisan ilmiah yang berlaku;
3. Pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya, dan apabila di kemudian hari terdapat penyimpangan dan atau ketidakbenaran dalam pernyataan ini, maka saya bersedia menerima sanksi akademis dan sanksi-sanksi lainnya yang sesuai dengan peraturan perundang-undangan yang berlaku.

Malang, 20 Desember 2024

Yang Membuat Pernyataan,


Aqli Bernas

REPUBLIC OF INDONESIA
10000
9BF3EAKX822017110

PREDICTION OF BANKING SECTOR STOCK PRICES IN BADAN USAHA
MILIK NEGARA ON THE INDONESIA STOCK EXCHANGE

Aqli Bernas

Department of Management, FEB UMM

E-mail : aqlibernas@webmail.umm.ac.id

ABSTRACT

This study predicts the stock prices of the banking sector in BUMN for the period from December 1, 2024, to February 28, 2025, using the Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) model. The data used consists of historical closing prices of banking sector stocks from September 1, 2024, to November 30, 2024. The research steps include: Data Presentation, Data Plotting, Stationarity Testing, Determination of ARIMA parameters p , d , and q , and Prediction. The prediction results indicate that the stocks of Bank Rakyat Indonesia (BBRI) and Bank Mandiri (BMRI) show a downward trend (bearish), the stocks of Bank Negara Indonesia (BBNI), Bank Tabungan Negara (BBTN), and Bank Raya Indonesia (AGRO) show a sideways price movement, and the stocks of Bank Syariah Indonesia (BRIS) show an upward trend (bullish). Investors are advised to make buy decisions on undervalued stocks and sell decisions on overvalued stocks. This study is expected to enrich the literature in the field of investment with a focus on stock price prediction using the autoregressive integrated moving average (ARIMA) model and to serve as a reference for future research. This study can be used as an educational resource for short-term investors who focus on earning stock income from capital gains.

Keywords: ARIMA, BUMN, Prediction

PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERBANKAN PADA BADAN USAHA MILIK NEGARA DI BURSA EFEK INDONESIA

Aqli Bernas

Program Studi Manajemen, FEB UMM
E-mail : aqlibernas@webmail.umm.ac.id

ABSTRAK

Penelitian ini memprediksi saham sektor perbankan di BUMN untuk periode (1 Desember 2024 – 28 Februari 2025) menggunakan Model *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA). Data yang digunakan berupa data historis *close price* saham sektor perbankan dari 1 September 2024 – 30 November 2024 dengan langkah penelitian yaitu: Penyajian Data, Plot Data, Pemeriksaan Kestasioneran Data, Penentuan Parameter p, d dan q dalam ARIMA, dan Prediksi. Hasil prediksi menunjukkan bahwa saham Bank Rakyat Indonesia (BBRI) dan Bank Mandiri (BMRI) mengalami tren penurunan (*bearish*), Saham Bank Negara Indonesia (BBNI), Bank Tabungan Negara (BBTN), dan Bank Raya Indonesia (AGRO) menunjukkan pergerakan harga mendatar (*sideways*), dan saham Bank Syariah Indonesia (BRIS) menunjukkan tren peningkatan (*bullish*). Investor diharapkan dapat mengambil keputusan beli atas saham-saham yang *undervalued* dan mengambil keputusan jual atas saham-saham yang *overvalued*. Penelitian ini diharapkan mampu memperkaya literatur dalam bidang investasi dengan fokus pada prediksi harga saham menggunakan *autoregressive integrated moving average* (ARIMA) dan hasil Penelitian ini diharapkan dapat menjadi sumber referensi bagi penelitian selanjutnya. Penelitian ini dapat digunakan sebagai edukasi untuk para investor jangka pendek yang fokus mencari pendapatan saham dari *capital gain*.
Kata Kunci: ARIMA, BUMN, Prediksi.



KATA PENGANTAR

Bismillahirrohmanirrohim

Puji syukur yang teramat mendalam saya ucapkan ke hadirat Tuhan Yang Maha Segala, atas percikan kasih, hidayah, rahmat dan tafaq-Nya, sehingga Skripsi dengan judul “Prediksi Harga Saham Sektor Perbankan pada Badan Usaha Milik Negara di Bursa Efek Indonesia”, dapat terselesaikan sesuai dengan waktu yang direncanakan.

Teriring do'a dan sholawat, senantiasa melimpah ke haribaan Muhammad S.A.W., Rasul akhir zaman, penutup para Nabi yang membawa kesempurnaan ajaran Tauhid dan keutamaan budi pekerti. Semoga tumpahan do'a sholawat menetes kepada segenap keluarga dan sahabatnya, para syuhada', para mushonnifin, para ulama', dan seluruh umatnya, yang dengan tulus ikhlas mencintai dan menjunjung sunnahnya.

Selama proses penyusunan skripsi, banyak pihak yang telah memberikan bantuan dan dukungan kepada saya. Sebagai ucapan syukur, dalam kesempatan ini, saya ingin mengucapkan terima kasih kepada:

1. Rektor Universitas Muhammadiyah Malang, Prof. Dr. Nazaruddin Malik, SE., M.Si. Atas kesempatan yang telah diberikan untuk menempuh pendidikan di Universitas Muhammadiyah Malang.
2. Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Malang Prof. Dr. Idah Zuhroh, M.M. Atas kesempatan yang telah diberikan untuk menempuh pendidikan di Fakultas Ekonomi dan Bisnis.
3. Ketua Program Studi, Dr. Nurul Asfiah, M.M. Atas kesempatan yang telah diberikan untuk menempuh pendidikan di program studi Manajemen.
4. Dosen Pembimbing I, Dr. Dewi Nurjanah, M.M. Atas arahan dan bimbingan skripsi selama satu semester.
5. Dosen Pembimbing II, Fika Fitriyari, S.E., M.M., Ph.D. Atas arahan dan bimbingan skripsi selama satu semester.

6. Seluruh pihak yang telah membantu penulis, yang tidak bisa sebutkan satu-persatu tanpa mengurangi rasa hormat yang telah memberikan dorongan dan bantuan sehingga skripsi ini terselesaikan.
7. Secara khusus, orang tua dan keluarga tercinta, atas dukungannya selama berkuliah di Universitas Muhammadiyah Malang.

Hanya ungkapan terima kasih dan do'a tulus yang dapat saya persembahkan, semoga segala yang telah mereka berikan kepada saya, tercatat dengan tinta emas dalam lembaran catatan Roqib sebagai sebuah ibadah yang tiada ternilai.

Aamiin Yaa Robbal Aallamiin.

Akhirnya, dengan segala keterbatasan dan kekurangan, saya persembahkan karya tulis ini kepada siapapun yang membutuhkannya. Kritik yang konstruktif dan saran dari semua pihak sangat saya harapkan untuk penyempurnaan karya-karya saya selanjutnya. Terima kasih.

Malang, 07 Januari 2025

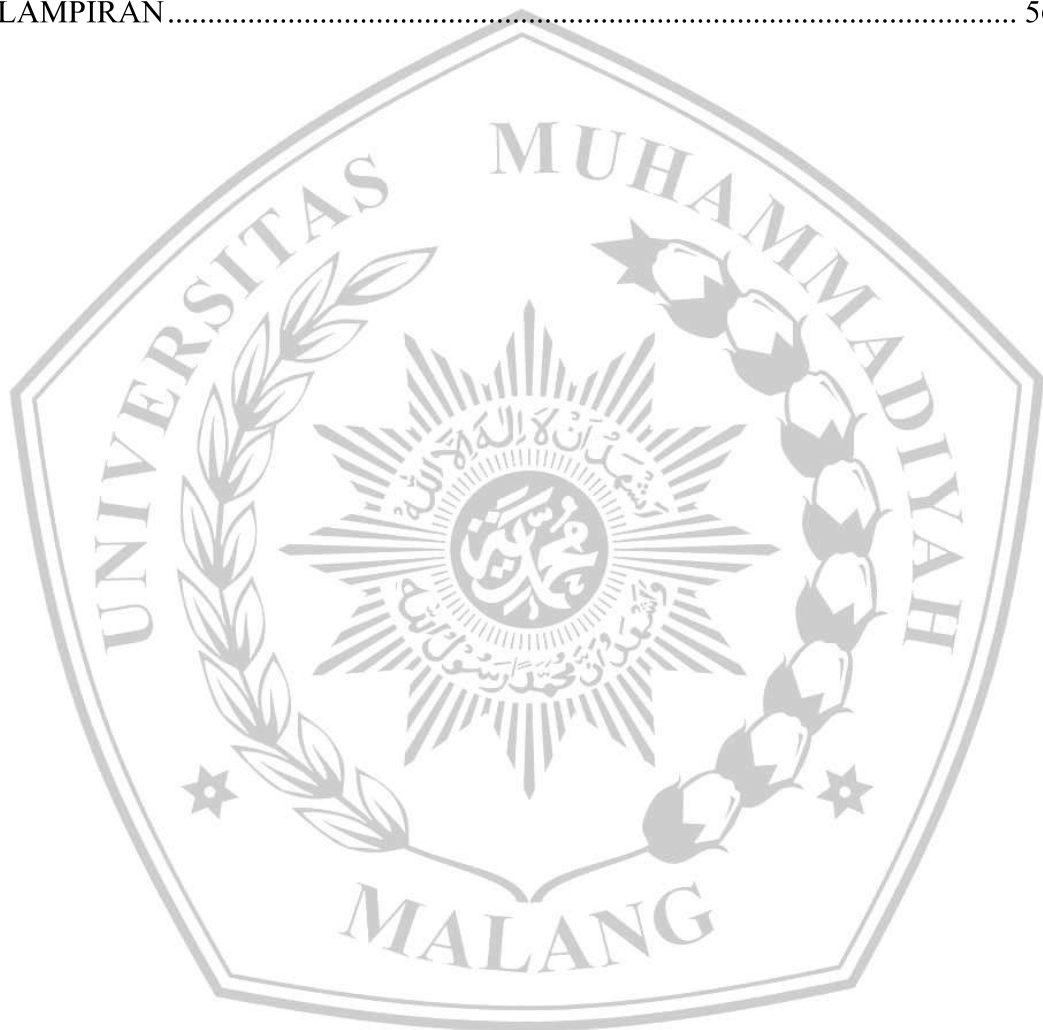
Penulis, Aqli Bernas



DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN.....	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian.....	9
D. Manfaat Penelitian	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
A. Landasan Teori	10
B. Penelitian Terdahulu.....	22
C. Model Penelitian	30
BAB III METODE PENELITIAN.....	32
A. Jenis Desain Penelitian.....	32
B. Obyek dan Waktu Penelitian.....	32
C. Populasi dan Sampel	32
D. Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	33
E. Metode Analisis Data	34
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	36
A. Deskripsi Data	36
B. Hasil Penelitian	38
C. Pembahasan.....	46

BAB V PENUTUP.....	49
A. Kesimpulan	49
B. Implikasi Penelitian.....	49
C. Keterbatasan Penelitian.....	50
D. Rekomendasi bagi Peneliti Selanjutnya.....	50
DAFTAR PUSTAKA.....	51
LAMPIRAN.....	56



DAFTAR TABEL

Tabel 1. Karakteristik Saham	21
Tabel 2. Uji Stasioner Data	39
Tabel 3. Hasil Plot PACF dan ACF	40
Tabel 4. Estimasi Parameter	41



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1. Grafik Saham BBRI, BMRI, dan BBNI.....	5
Gambar 1. 2. Grafik Saham BBTN dan BRIS	6
Gambar 1. 3. Grafik saham AGRO	7
Gambar 2. 1. Model Penelitian	30
Gambar 4. 1. Plot Aktual Close Price Saham BBRI, BMRI, dan BBNI.....	37
Gambar 4. 2. Plot Aktual Close Price Saham BBTN dan BRIS	37
Gambar 4. 3. Plot Aktual Close Price Saham AGRO	38
Gambar 4. 4. Hasil Prediksi Harga Saham Bank Rakyat Indonesia (BBRI)	42
Gambar 4. 5. Hasil Prediksi Harga Saham Bank Mandiri (BMRI)	43
Gambar 4. 6. Hasil Prediksi Harga Saham Bank Negara Indonesia (BBNI).....	44
Gambar 4. 7. Hasil Prediksi Harga Saham Bank Tabungan Negara (BBTN).....	44
Gambar 4. 8. Hasil Prediksi Harga Saham Bank Syariah Indonesia (BRIS).....	45
Gambar 4. 9. Hasil Prediksi Harga Saham Bank Raya Indonesia (AGRO)	46

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Harga Saham Bank Rakyat Indonesia (BBRI).....	56
Lampiran 2. Data Harga Saham Bank Mandiri (BMRI).....	57
Lampiran 3. Data Harga Saham Bank Negara Indonesia (BBNI)	58
Lampiran 4. Data Harga Saham Bank Tabungan Negara (BBTN)	59
Lampiran 5. Data Harga Saham Bank Syariah Indonesia (BRIS)	60
Lampiran 6. Data Harga Saham Bank Raya Indonesia (AGRO).....	61
Lampiran 7. Uji Stasioner BBRI Level 0.....	62
Lampiran 8. Uji Stasioner BBRI 1st <i>Difference</i>	62
Lampiran 9. Uji Stasioner BMRI Level 0.....	63
Lampiran 10. Uji Stasioner BMRI 1st <i>Difference</i>	63
Lampiran 11. Uji Stasioner BBNI Level 0.....	64
Lampiran 12. Uji Stasioner BBNI 1st <i>Difference</i>	64
Lampiran 13. Uji Stasioner BBTN Level 0	65
Lampiran 14. Uji Stasioner BBTN 1st <i>Difference</i>	65
Lampiran 15. Uji Stasioner BRIS Level 0	66
Lampiran 16. Uji Stasioner BRIS 1st <i>Difference</i>	66
Lampiran 17. Uji Stasioner AGRO Level 0.....	67
Lampiran 18. Uji Stasioner AGRO 1st <i>Difference</i>	67
Lampiran 19. Hasil Correlogram PACF & ACF (BBRI).....	68
Lampiran 20. Hasil Correlogram PACF & ACF (BMRI).....	68
Lampiran 21. Hasil <i>Correlogram</i> PACF & ACF (BBNI)	69
Lampiran 22. Hasil Correlogram PACF & ACF (BBTN).....	69
Lampiran 23. Hasil <i>Correlogram</i> PACF & ACF (BRIS).....	70
Lampiran 24. Hasil <i>Correlogram</i> PACF & ACF (AGRO)	70
Lampiran 25. Estimasi Parameter BBRI ARIMA (0, 1, 1)	71
Lampiran 26. Estimasi Parameter BBRI ARIMA (1, 1, 0)	71
Lampiran 27. Estimasi Parameter BBRI ARIMA (1, 1, 1)	72
Lampiran 28. Estimasi Parameter BMRI ARIMA (0, 1, 1)	72
Lampiran 29. Estimasi Parameter BMRI ARIMA (1, 1, 0)	73

Lampiran 30. Estimasi Parameter BMRI ARIMA (1, 1, 1)	73
Lampiran 31. Estimasi Parameter BBNI ARIMA (0, 1, 1)	74
Lampiran 32. Estimasi Parameter BBNI ARIMA (1, 1, 0)	74
Lampiran 33. Estimasi Parameter BBNI ARIMA (1, 1, 1)	75
Lampiran 34. Estimasi Parameter BBTN ARIMA (0, 1, 1)	75
Lampiran 35. Estimasi Parameter BBTN ARIMA (1, 1, 0)	76
Lampiran 36. Estimasi Parameter BBTN ARIMA (1, 1, 1)	76
Lampiran 37. Estimasi Parameter BRIS ARIMA (0, 1, 1)	77
Lampiran 38. Estimasi Parameter BRIS ARIMA (1, 1, 0)	77
Lampiran 39. Estimasi Parameter BRIS ARIMA (1, 1, 1)	78
Lampiran 40. Estimasi Parameter AGRO ARIMA (2, 1, 2)	78
Lampiran 41. Uji Asumsi Residual BBRI ARIMA (1, 1, 1)	79
Lampiran 42. Uji Asumsi Residual BMRI ARIMA (0, 1, 1)	79
Lampiran 43. Uji Asumsi Residual BBNI ARIMA (1, 1, 1)	80
Lampiran 44. Uji Asumsi Residual BBTN ARIMA (1, 1, 1)	80
Lampiran 45. Uji Asumsi Residual BRIS ARIMA (0, 1, 1)	81
Lampiran 46. Uji Asumsi Residual AGRO ARIMA (2, 1, 2)	81
Lampiran 47. Prediksi Harga Saham Bank Rakyat Indonesia (BBRI)	82
Lampiran 48. Prediksi Harga Saham Bank Mandiri (BMRI)	83
Lampiran 49. Prediksi Harga Saham Bank Negara Indonesia (BBNI)	84
Lampiran 50. Prediksi Harga Saham Bank Tabungan Negara (BBTN)	85
Lampiran 51. Prediksi Harga Saham Bank Syariah Indonesia (BRIS)	86
Lampiran 52. Prediksi Harga Saham Bank Raya Indonesia (AGRO)	87

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). *Manajemen Investasi dan Portofolio* (Melati, Ed.). Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS).
- Ahmar, A. S., Singh, P. K., van Thanh, N., Tinh, N. V., & Hieu, V. M. (2021). Prediction of BRIC stock price using ARIMA, SutteARIMA, and holt-winters. *Computers, Materials and Continua*, *70*(1), 523–534. <https://doi.org/10.32604/cmc.2022.017068>
- Al Wadi, S., Al Singlawi, O., Jaber, J. J., Saleh, M. H., & Shehadeh, A. A. (2024). Enhancing Predictive Accuracy through the Analysis of Banking Time Series: A Case Study from the Amman Stock Exchange. *Journal of Risk and Financial Management*, *17*(98), 1–13. <https://doi.org/10.3390/jrfm17030098>
- Amunugama, A. W. V. M., Abeysundara, H. T. K., & Dissanayaka, U. N. B. (2022). ARIMA and FBMAP approach for forecasting daily stock price in Colombo Stock Exchange, Sri Lanka. *Ceylon Journal of Science*, *51*(3), 259–267. <https://doi.org/10.4038/cjs.v51i3.8033>
- Assous, H. F., Al-Rousan, N., Al-Najjar, D., & Al-Najjar, H. (2020). Can international market indices estimate TASI's movements? The ARIMA model. *Journal of Open Innovation: Technology, Market, and Complexity*, *6*(27), 1–17. <https://doi.org/10.3390/joitmc6020027>
- Bagalkot, S. S., Dinesha, H. A., & Naik, N. (2024). Novel Grey Wolf Optimizer Based Parameters Selection for GARCH and ARIMA Models for Stock Price Prediction. *PeerJ Computer Science*, *10*, 1–20. <https://doi.org/10.7717/peerj-cs.1735>
- Bastian, F., & Sari Islami, F. (2021). Peramalan Harga Saham PT. Bank Mandiri (Persero) Tbk. Menggunakan Metode ARIMA. *Jurnal Paradigma Multidisipliner (JPM)*, *2*(2), 111–118.
- Gitman, L. J., & Zutter, C. J. (2015). *Principles of Managerial Finance* (14 ed.). Pearson Education Limited.

- Gong, X. (2024). ARIMA-BPNN Based Stock Price Prediction Model Based on Fusion News Sentiment Analysis. *Scalable Computing*, 25(3), 2062–2075. <https://doi.org/10.12694/SCPE.V25I3.2717>
- Handini, S., & Astawinetu, E. D. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Scopindo Media Pustaka.
- Htun, H. H., Biehl, M., & Petkov, N. (2024). Forecasting Relative Returns for S&P 500 Stocks using Machine Learning. *Financial Innovation*, 10(1), 118. <https://doi.org/10.1186/s40854-024-00644-0>
- Khan, S., & Alghulaiakh, H. (2020). ARIMA Model for Accurate Time Series Stocks Forecasting. (*IJACSA*) *International Journal of Advanced Computer Science and Applications*, 11(7), 524–528. www.ijacsa.thesai.org
- Khoiri, H. A. (2023). *Analisis Deret Waktu Univariat* (1 ed.). UNIPMA PRESS.
- Kotu, V., & Deshpande, B. (2019). *Data Science: Concepts and Practice* (2 ed.). Elsevier Science.
- Lahboub, K., & Benali, M. (2024). Assessing the Predictive Power of Transformers, ARIMA, and LSTM in Forecasting Stock Prices of Moroccan Credit Companies. *Journal of Risk and Financial Management*, 17(293), 1–15. <https://doi.org/10.3390/jrfm17070293>
- Low, P. R., & Sakk, E. (2023). Comparison Between Autoregressive Integrated Moving Average and Long Short Term Memory Models for Stock Price Prediction. *IAES International Journal of Artificial Intelligence*, 12(4), 1828–1835. <https://doi.org/10.11591/ijai.v12.i4.pp1828-1835>
- Malik, P., Dangi, A. S., Singh, A., Asst, T., Pratap, A., Parihar, S., Sharma, U., & Mishra, L. (2023). An Analysis of Time Series Analysis and Forecasting Techniques. *IJARIE*, 1364–1374. <https://www.researchgate.net/publication/375238697>
- Maulia, Triwulandari, Fauzan, Khoerunnisa, Aziz, & Mangku. (2020). Perbandingan Kinerja Model ARIMA dan GARCH dalam Peramalan Harga Saham Bank BRI.

MILANG Journal of Mathematics and Its Applications, 20(1), 65–76.
<https://doi.org/10.29244/milang.20.1.65-76>

Meher, B. K., Hawaldar, I. T., Spulbar, C., & Birau, R. (2021). Forecasting Stock Market Prices using Mixed ARIMA model: A Case Study of Indian Pharmaceutical Companies. *Investment Management and Financial Innovations*, 18(1), 42–54.
[https://doi.org/10.21511/imfi.18\(1\).2021.04](https://doi.org/10.21511/imfi.18(1).2021.04)

Mohan, M., C. Kishore Raja, P., Velmurugan, P., & Kulothungan, A. (2023). Holt-Winters Algorithm to Predict the Stock Value Using Recurrent Neural Network. *Intelligent Automation & Soft Computing*, 35(1), 1151–1163.
<https://doi.org/10.32604/iasc.2023.026255>

Muzakki, A. F., Aditama, D., & Anugrah, I. G. (2022). Penerapan Metode Autoregressive Integrated Moving Average untuk Memprediksi Penggunaan Barang Medis pada Logistik Medis Rumah Sakit Muhammadiyah Gresik. *INDEXIA: Informatic and Computational Intelligent Journal*, 4(1), 1–16.

Natasya, S. V., & Awangga, R. M. (2023). *Membuat Analisis Komparatif ARIMA & Prophet pada Peramalan Penjualan*. Penerbit Buku Pedia.

Otoritas Jasa Keuangan. (2024). *Siaran Pers-Refleksi 2024: Perbankan Indonesia Tetap Solid dan Melangkah Optimis di Tengah Ketidakpastian Ekonomi Global*.

Pratama, K. J. (2024, April 11). Menuju Ekonomi Berkeadilan: Optimalisasi Sektor Perbankan BUMN. *Kementerian Sekretariat Negara Republik Indonesia*.

Purnama, J., & Juliana, A. (2019). Analisa Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan Menggunakan Metode ARIMA. *Cakrawala management Business Journal*, 2(2), 454–468.

Putra, A. L., & Kurniawati, A. (2021). Analisis Prediksi Harga Saham PT. Astra International Tbk Menggunakan Metode Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) dan Support Vector Regression (SVR). *Jurnal Ilmiah Komputasi*, 20(3), 417–423. <https://doi.org/10.32409/jikstik.20.3.2732>

- Putri, S. N. (2024). Ada yang Berdiri Sejak 1998, Apa Saja 6 Bank BUMN di Indonesia? *IDX Channel*. https://www.idxchannel.com/amp/banking/ada-yang-berdiri-sejak-1998-apa-saja-6-bank-bumn-di-indonesia?utm_source=investing&utm_medium=aggregator
- Rachbini, W., Sumarto, A. H., & Evil, T. (2021). *Statistika Terapan Pengolahan Data Time Series Menggunakan Eviews*. CV. AA. Rizky.
- Rubio, L., & Alba, K. (2022). Forecasting Selected Colombian Shares Using a Hybrid ARIMA-SVR Model. *Mathematics*, 10(2181), 1–21. <https://doi.org/10.3390/math10132181>
- Rusyida, W. Y. (2022). *Teknik Peramalan Metode ARIMA dan Holt Winter*. Penerbit NEM.
- Sholikah, F. P., Putri, W., & Djangi, R. M. (2022). Peranan Pasar Modal Dalam Perekonomian Negara Indonesia. *ARBITRASE: Journal of Economics and Accounting*, 3(2), 341–345. <https://doi.org/10.47065/arbitrase.v3i2.496>
- Singh, B., Kumar Henge, S., Mandal, S. K., Yadav, M. K., Yadav, P. T., Upadhyay, A., Iyer, S., & Gupta, R. A. (2023). Auto-Regressive Integrated Moving Average Threshold Influence Techniques for Stock Data Analysis. *IJACSA) International Journal of Advanced Computer Science and Applications*, 14(6), 446–455. www.ijacsa.thesai.org
- Sugiyono. (2020). *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D* (Sutopo, Ed.; 2 ed.). Alfabeta.
- Susanti, R., & Adji, A. R. (2020). Analisis Peramalan IHSG dengan Time Series Modeling ARIMA. *Jurnal Manajemen Kewirausahaan*, 17(1), 97–106. <https://doi.org/10.33370/jmk.v17i1.393>
- Tannadi, B. (2020). *Ilmu Saham: Pengenalan Saham*. Elex Media Komputindo.
- Tu, S., Huang, J., Mu, H., Lu, J., & Li, Y. (2024). Combining Autoregressive Integrated Moving Average Model and Gaussian Process Regression to Improve Stock Price Forecast. *Mathematics*, 12(8), 1–14. <https://doi.org/10.3390/math12081187>

Zain, H. H., & Fauzan, M. N. (2023). *Peramalan Terhadap Permintaan Produk dalam Sektor Logistik di Indonesia* (R. Habibi, Ed.). Penerbit Buku Pedia.

Zakaria. (2023). *Indeks Harga Saham di Bursa Efek Indonesia* (A. Rasyid, Ed.). Tohar Media.





Lembaga Informasi dan Publikasi
Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Muhammadiyah Malang
Tanda Terima Cek Plagiasi

Tanggal : 12/23/2024

Kode : 2472287
Nama : Aqli Bemas
NIM : 202110160311020
Prodi : Manajemen
Judul Penelitian : Prediksi Harga Saham Sektor Perbankan pada Badan Usaha Milik Negara di Bursa Efek Indonesia
Persentase Plagiasi : 4%
Keterangan : LULUS

Kepala LIP



Rinaldy Achmad Roberth Fathoni, S.AB., M.M

