

ABSTRAK

Saham merupakan salah satu alat yang di pakai di pasar modal yang sangat diminati oleh investor. Pergerakan saham yang fluktuatif di pasar modal menyebabkan banyak calon investor ingin mengetahui saham-saham yang prospektif untuk dibeli saat ini maupun di masa yang akan datang. Data saham merupakan data runtun waktu yang biasanya bersifat random (acak) dan juga memiliki volatilitas yang tinggi. Dalam kasus pemodelan *time series* dengan metode ARIMA menjadi kurang tepat untuk digunakan, maka diperlukan metode lain untuk mengatasi gejala heteroskedastisitas tersebut. Dalam penelitian ini menggunakan metode ARCH/GARCH karena metode ini mampu mengatasi gejala heteroskedastisitas. Hasil dari penelitian ini menggunakan model ARIMA (1,1,1)-GARCH (3,1) yang di anggap tepat dan baik untuk memprediksi saham Apple Inc ini.

Kata kunci: *ARCH/GARCH, Heteroskedastisitas, Saham*