

## ABSTRAK

Ferdy, Hanna Felina. 2022. Peramalan Harga Saham PT. Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk Di Masa Pandemi Covid-19 Menggunakan Metode *Hybrid Autoregressive Integrated Moving Average - Artificial Neural Network (ARIMA-ANN)*. Skripsi, Program Studi Statistika, Universitas Muhammadiyah Semarang, Pembimbing I: Ibu Indah Manfaat Nur M.Si, Pembimbing II : Ibu Tiani Wahyu Utami, M.Si.

Pneumonia baru yang disahkan oleh WHO mengenai wabah yang dinamakan covid-19. Dimana, seluruh dunia merasakannya termasuk Indonesia pada 09 Maret 2020. Wabah covid-19 memberikan dampak yang besar termasuk ke dunia investasi, salah satunya ialah saham. PT. Bank Rakyat Indonesia yang menjadi salah satu bagian dari dunia investasi juga merasakan kerugian yang cukup besar karena nilai saham yang rendah. Tujuan dari penelitian ini ialah untuk mengetahui nilai saham kedepannya sehingga PT. Bank Rakyat Indonesia dapat mengantisipasinya serta dapat mengetahui metode terbaik yang dapat digunakan untuk meramalkan harga saham. Data yang digunakan ialah harga saham *open* dan *close* pada bulan Maret 2020 sampai Juli 2021. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa harga saham *open* dan *close* metode *Hybrid* ARIMA-ANN memiliki nilai MAPE yang lebih kecil sebesar 2% dibandingkan dengan metode ARIMA yaitu sebesar 9% . Sehingga, metode *Hybrid* ARIMA-ANN merupakan metode yang lebih unggul dibandingkan metode ARIMA.

**Kata Kunci:** ARIMA, *Hybrid* ARIMA-ANN, Saham, BBRI, Peramalan

