

Abstrak

Saham merupakan surat berharga atau satuan nilai dalam berbagai instrumen finansial yang menunjukkan bagian kepemilikan atas sebuah perusahaan. Menerbitkan saham merupakan salah satu pilihan perusahaan ketika memutuskan pendanaan perusahaan. Pada penelitian ini, dilakukan prediksi pergerakan saham pada PT United Tractors dengan menggunakan metode *Vector Autoregressive* (VAR) dengan melibatkan variabel lain yaitu Harga Kurs Beli Rupiah ke USD. VAR merupakan metode prediksi yang menggunakan lebih dari satu variabel untuk dijadikan pertimbangan dalam memprediksi suatu data dengan kondisi data tersebut harus saling berkorelasi. Penelitian ini menggunakan inputan data berupa Harga Saham Penutup yang dipengaruhi oleh Harga Kurs beli Rupiah ke USD. Data yang digunakan pada penelitian ini merupakan data historis dari PT United Tractors Indonesia dan harga kurs Rupiah ke USD dari Januari 2015 hingga Agustus 2019. Hasil yang didapat pada penelitian ini adalah harga prediksi Harga Saham Penutup PT United Tractors Tbk dengan nilai MAPE VAR(1) sebesar 0,0197% dan VAR(2) sebesar 0,0194%.

Kata kunci : prediksi, saham, *Vector Autoregressive*, Non-Stationer.