

ABSTRAK

PERAMALAN HARGA SAHAM NETFLIX MENGGUNAKAN METODE ARCH/GARCH

Oleh

Niesya Ayunda Febriyanti (20110033)

Pemberlakuan Pembatasan Sosial Berskala Besar (PSBB) saat masa pandemi Covid-19 membuat sebagian besar bioskop di seluruh Indonesia terpaksa harus ditutup sementara. Hal tersebut membuat penggemar film mencari alternatif hiburan untuk mengisi waktu luangnya. Netflix adalah *platform streaming* berbasis langganan yang populer dan paling banyak diakses di masa pandemi Covid-19. Faktor kenyamanan, aksesibilitas, pilihan konten yang bervariasi, biaya lebih rendah, fleksibilitas, dan privasi adalah alasan Netflix dipilih sebagai alternatif menonton film dan membuat Netflix mengalami peningkatan jumlah pelanggan yang signifikan di tahun 2020. Namun, terjadi penurunan drastis pada harga saham Netflix hingga 70% di tengah-tengah penurunan jumlah pelanggan, yang menyebabkan pemutusan hubungan kerja pada ratusan karyawan pada tahun 2022. Penelitian ini dilakukan untuk meramalkan harga saham Netflix menggunakan model terpilih dari metode peramalan *ARCH/GARCH*. Metode ini memiliki kemampuan dalam mengatasi heteroskedastisitas dan volatilitas yang tidak stabil yang sering terjadi dalam data keuangan. Berdasarkan penelitian yang dilakukan, model terbaik yang didapatkan adalah *ARCH (2)* dengan hasil evaluasi *RMSE* sebesar 42.192, *MAE* sebesar 37.287, dan *MAPE* sebesar 8,933%. Hasil peramalan menunjukkan adanya kenaikan dan penurunan di bulan September 2023.

Kata Kunci: saham Netflix, peramalan, ARCH, GARCH