

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 KESIMPULAN

Berdasarkan hasil penelitian yang telah dilakukan mengenai peramalan harga saham Bank Rakyat Indonesia (BBRI) menggunakan metode ARIMA dengan bantuan perangkat lunak EViews, dapat ditarik beberapa kesimpulan sebagai berikut:

1. Data harga saham BBRI periode 2 Januari 2020 hingga 30 Desember 2024 menunjukkan adanya fluktuasi yang cukup signifikan, sehingga diperlukan metode statistik untuk memprediksi pola pergerakannya.
2. Setelah melalui tahapan uji stasioneritas dan proses differencing, model ARIMA yang paling optimal ditetapkan adalah Model 7 yaitu ARIMA (3,1,2). Model ini dipilih karena menghasilkan nilai Sum of Squared Residuals (SSR) dan Akaike Information Criterion (AIC) terkecil dibandingkan model kandidat lainnya.
3. Hasil peramalan selama 10 hari ke depan menunjukkan kecenderungan harga saham BBRI yang relatif stabil dengan sedikit variasi pergerakan. Hal ini menandakan bahwa dalam jangka pendek, harga saham BBRI tidak mengalami perubahan signifikan.

4. Tingkat akurasi model diukur menggunakan Mean Absolute Percentage Error (MAPE) dan diperoleh hasil sebesar 2,26%. Nilai ini menunjukkan bahwa model ARIMA memiliki tingkat kesalahan yang rendah sehingga sangat layak digunakan untuk peramalan jangka pendek.
5. Meskipun ARIMA cukup efektif untuk prediksi jangka pendek, metode ini memiliki keterbatasan dalam peramalan jangka panjang karena hasilnya cenderung flat dan berulang sehingga tidak mampu menangkap dinamika perubahan pasar secara menyeluruh.

5.2 Saran

Berdasarkan kesimpulan tersebut, maka dapat diberikan beberapa saran sebagai berikut:

1. Penelitian selanjutnya disarankan untuk menggabungkan metode ARIMA dengan metode lain seperti GARCH, VAR, atau machine learning agar dapat menangkap dinamika pergerakan saham yang lebih kompleks.
2. Untuk meningkatkan ketepatan peramalan, sebaiknya digunakan variabel tambahan selain data historis harga saham, misalnya faktor makroekonomi, kebijakan moneter, atau sentimen pasar.
3. Penggunaan ARIMA sebaiknya difokuskan pada peramalan jangka pendek karena lebih sesuai dengan karakteristik metode ini. Untuk prediksi jangka

panjang, perlu dipertimbangkan penggunaan model alternatif yang lebih adaptif.

4. Investor maupun pihak yang berkepentingan sebaiknya tidak hanya mengandalkan hasil peramalan ARIMA, tetapi juga mempertimbangkan analisis fundamental dan teknikal agar keputusan investasi lebih komprehensif.

