

ABSTRAK

Pasar modal Indonesia telah menunjukkan perkembangan yang signifikan dalam beberapa tahun terakhir, dengan peningkatan jumlah investor mencapai 10,32 juta SID per Desember 2023, meningkat 31,06% dari tahun sebelumnya. Meski demikian, fluktuasi harga saham yang sulit diprediksi masih menjadi tantangan utama bagi Trader saham, dengan volatilitas yang dapat menyebabkan kerugian signifikan. Penelitian ini bertujuan untuk meramalkan pergerakan harga saham PT Bank Central Asia Tbk (BBCA) menggunakan metode SARIMA (*Seasonal Autoregressive Integrated Moving Average*) untuk periode 2019-2024. BBCA dipilih karena posisinya sebagai salah satu saham blue chip dengan kapitalisasi pasar terbesar di BEI. Data yang digunakan bersumber dari *Yahoo Finance* dengan rentang waktu Januari 2019 hingga Januari 2024. Melalui analisis dekomposisi data dan identifikasi pola musiman, hasil penelitian menunjukkan bahwa model SARIMA((1,0,0),(0,0,0,12)) dapat digunakan untuk meramalkan harga saham BBCA dengan akurat. Visualisasi data menunjukkan pola musiman yang jelas dengan tren kenaikan dalam periode tertentu. Berdasarkan hasil peramalan untuk 30 hari ke depan, harga saham BBCA menunjukkan tren kenaikan yang konsisten. Penelitian ini juga mengindikasikan bahwa pergerakan harga saham tidak hanya dipengaruhi oleh faktor waktu tetapi juga faktor eksternal lainnya.

Kata Kunci: Peramalan Harga Saham, SARIMA, BBCA.

ABSTRACT

The Indonesian capital market has shown significant development in recent years, with the number of investors reaching 10.32 million SID as of December 2023, an increase of 31.06% from the previous year. Nevertheless, unpredictable stock price fluctuations remain a major challenge for stock traders, with volatility potentially leading to significant losses. This research aims to forecast the stock price movement of PT Bank Central Asia Tbk (BBCA) using the SARIMA (Seasonal Autoregressive Integrated Moving Average) method for the 2019-2024 period. BBCA was selected due to its position as one of the blue-chip stocks with the largest market capitalization on the Indonesia Stock Exchange (IDX). The data used was sourced from Yahoo Finance, covering the period from January 2019 to January 2024. Through data decomposition analysis and seasonal pattern identification, the research results show that the SARIMA((1,0,0),(0,0,0,12)) model can be accurately applied to forecast BBCA stock prices. Data visualization reveals a clear seasonal pattern with an upward trend during certain periods. Based on the forecast for the next 30 days, BBCA stock prices exhibit a consistent upward trend. This study also indicates that stock price movements are influenced not only by time factors but also by external factors.

Keywords: Stock Price Forecasting, SARIMA, BBCA.