

BAB V

PENUTUP

A. Kesimpulan

Berdasarkan hasil penelitian ini dan pembahasan yang sudah dilakukan oleh peneliti, maka terdapat beberapa kesimpulan untuk Peramalan Harga Saham Mingguan PT. Bank BTPN Syariah Menggunakan Metode ARIMA yaitu sebagai berikut:

1. Dari estimasi model ARIMA yang diuji, Uji statistik *t* (*Test of Significance*) menunjukkan bahwa pada model ARIMA (10, 1, 2), nilai *t* hitung lebih besar daripada *t* tabel, dengan tingkat probabilitas di bawah 0,05 atau 5%. Dengan demikian, hipotesis nol (H_0) ditolak, yang berarti koefisien model tersebut signifikan. Oleh karena itu, dapat disimpulkan bahwa model ARIMA (10, 1,2) adalah model terbaik untuk meramalkan harga saham PT Bank BTPN Syariah.
2. Hasil peramalan harga saham mingguan PT Bank BTPN Syariah Tbk untuk periode satu tahun ke depan menggunakan model ARIMA (10,1,2) menunjukkan pola yang fluktuatif namun masih berada dalam rentang yang stabil. Pada minggu pertama, harga saham diprediksi sebesar Rp 914,2932, mengalami penurunan pada minggu kedua menjadi Rp

907,2881, kemudian meningkat kembali pada minggu ketiga menjadi Rp 926,0074. Pola naik-turun ini terus terjadi pada minggu-minggu selanjutnya, yang menunjukkan bahwa pergerakan harga saham fluktuatif. Tingkat akurasi model peramalan yang diukur menggunakan fungsi MAPE tercatat sebesar 4.541062. MAPE sebesar 4.54% menandakan model akurat karena kurang dari 10%. Nilai error yang kecil ini mengindikasikan bahwa kesalahan model sangat kecil, sehingga hasil peramalan dapat dianggap sangat akurat.

B. Saran

Berdasarkan hasil penelitian yang telah dilakukan oleh peneliti, maka penulis memberikan saran pada penelitian yang diajukan ini sebagai berikut:

1. Bagi PT Bank BTPN Syariah

PT Bank BTPN Syariah diharapkan kedepannya dapat mengimplementasikan metode peramalan baik untuk jangka pendek, menengah, maupun jangka panjang, yang berpotensi memberikan manfaat bagi perusahaan. Berdasarkan hasil peramalan dalam penelitian ini, harga saham dalam periode mingguan untuk satu tahun ke depan diperkirakan akan berfluktuasi dan cenderung mengalami penurunan secara perlahan. Oleh karena itu, perusahaan diharapkan dapat

meningkatkan kinerjanya, mengingat kinerja perusahaan merupakan salah satu faktor yang mempengaruhi pergerakan harga saham

2. Bagi Investor atau Calon Investor

Bagi investor maupun calon investor yang berencana untuk berinvestasi saham dalam jangka pendek, penggunaan metode ARIMA dapat dijadikan sebagai salah satu acuan penting dalam proses pengambilan keputusan. Metode ini dapat membantu memprediksi pergerakan harga saham di masa depan, sehingga dapat memberikan gambaran yang lebih jelas terkait peluang dan risiko yang mungkin dihadapi. Salah satu aspek yang perlu diperhatikan dalam menganalisis pergerakan harga saham adalah kinerja perusahaan, terutama yang tercermin melalui laporan keuangannya. Oleh karena itu, sangat dianjurkan bagi para investor memperhatikan indikator keuangan seperti EPS (*Earnings Per Share*). Memilih perusahaan dengan EPS yang terus meningkat dari tahun ke tahun dapat menjadi strategi yang baik, mengingat peningkatan EPS biasanya berhubungan erat dengan pertumbuhan laba yang pada akhirnya akan meningkatkan keuntungan yang diperoleh investor.

3. Bagi Peneliti Selanjutnya

Untuk penelitian selanjutnya, diharapkan para peneliti dapat mengembangkan model prediksi yang lebih luas cakupannya, misalnya

dengan membangun pemodelan untuk jangka panjang. Dengan memperluas horizon waktu analisis, hasil penelitian ke depan diharapkan dapat memberikan manfaat yang lebih besar, terutama bagi investor atau pihak-pihak lain yang memerlukan prediksi dalam rentang waktu yang lebih panjang. Selain itu, peneliti juga disarankan untuk memperdalam pemahaman terhadap berbagai model time series lainnya, seperti ARCH, ARMAX, ARIMAX, dan sebagainya. Pendalaman ini bertujuan agar dapat memilih model yang paling sesuai dengan karakteristik data dan kebutuhan analisis, sehingga hasil peramalan yang diperoleh menjadi lebih akurat dan relevan dengan kondisi pasar yang dinamis.