

BAB V

KESIMPULAN

5.1 Kesimpulan

Penelitian prediksi harga saham menggunakan algoritma *Generalized Linear Model (GLMs)* dan *Auto Regressive Integrated Moving Average (ARIMA)* pada indeks LQ45 telah berhasil dilakukan. Berdasarkan analisis, kesimpulan penelitian ini adalah sebagai berikut :

1. Data diambil dari *yahoo finance* yang mencakup tanggal, harga pembukaan, harga terendah, harga tertinggi, harga penutupan dan volume.
2. Algoritma *Generalized Linear Model (GLMs)* menghasilkan nilai MAPE terkecil 1,132 % pada saham XL Akiata Tbk dan nilai MAPE terbesar 6,634% pada saham Unilever Indonesia Tbk.
3. Nilai MAPE terkecil 1,450 % pada saham XL Akiata Tbk dan nilai MAPE terbesar 20,020 % pada saham Aneka Tambang Tbk dihasilkan melalui metode ARIMA.
4. Hasil akurasi model yang dilihat berdasarkan nilai MAPE menunjukkan bahwa algoritma GLMs cenderung memiliki kinerja lebih baik pada prediksi harga saham dibandingkan menggunakan metode ARIMA karena mampu menangani variasi distribusi data. Penggunaan algoritma *Generalized Linear Model* dan ARIMA dapat digunakan untuk prediksi harga saham pada indeks LQ45 karena menunjukkan nilai rata-rata MAPE dibawah 10% yang menggambarkan performa model cukup baik.

5.2 Saran

Berdasarkan pengujian dalam penelitian ini, memberikan rekomendasi kepada peneliti dimasa mendatang untuk meningkatkan akurasi model yang lebih representatif terhadap kondisi pasar yang dinamis. Beberapa saran untuk pengembangan penelitian berikutnya antara lain dapat dilihat pada halaman berikutnya :

1. Penelitian selanjutnya untuk mengeksplorasi model prediksi lain seperti LSTM, XGBoost atau *hybrid models* yang memiliki prediksi jangka panjang untuk dibandingkan dengan metode GLMs dan ARIMA.
2. Menggunakan tuning ARIMA secara otomatis untuk memilih parameter terbaik (p,d,q) menggunakan kriteria *Akaike Informasi Criterion* (AIC) dan *Bayesian* (BIC).
3. Melakukan analisis yang mendalam mengenai faktor-faktor fundamental dan analisis sektor pasar yang mempengaruhi harga saham untuk memperoleh pemahaman yang lebih komprehensif dan adaptif terhadap dinamika pasar.