

ABSTRAK

Prediksi harga saham merupakan salah satu aspek penting dalam analisis keuangan yang dapat membantu investor dalam pengambilan keputusan investasi. Penelitian ini bertujuan untuk memprediksi harga saham PT. Gudang Garam dengan menggunakan metode data mining dan model ARIMA (*AutoRegressive Integrated Moving Average*). Model ARIMA dipilih karena kemampuannya dalam menangkap pola temporal dan melakukan prediksi yang akurat berdasarkan data historis. Hasil penelitian menunjukkan bahwa model ARIMA (0,1,1) memberikan kinerja prediksi terbaik dengan nilai *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE), *Mean Absolute Error* (MAE), dan *Root Mean Square Error* (RMSE) yang terendah. Model ini berhasil menangkap tren yang terdapat dalam data harga saham PT. Gudang Garam. Prediksi yang dihasilkan oleh model ARIMA diharapkan dapat menjadi alat bantu yang berguna bagi investor dalam membuat keputusan investasi yang lebih informasional.

Kata Kunci: Prediksi Harga Saham, *Data Mining*, Model ARIMA, Data Historis PT. Gudang Garam.

ABSTRACT

Stock price prediction is one of the important aspects in financial analysis that can help investors in making investment decisions. This research aims to predict the stock price of PT Gudang Garam by using data mining methods and the ARIMA (AutoRegressive Integrated Moving Average) model. The ARIMA model was chosen because of its ability to capture temporal patterns and make accurate predictions based on historical data. The results show that the ARIMA (0,1,0) model provides the best prediction performance with the lowest Mean Absolute Percentage Error (MAPE), Mean Absolute Error (MAE), and Root Mean Square Error (RMSE) values. This model successfully captures the trends contained in the PT Gudang Garam Tbk stock price data. Predictions generated by the ARIMA model are expected to be a useful tool for investors in making more informational investment decisions.

Keywords: *Stock Price Prediction, Data Mining, ARIMA Model, Historical Data of PT. Gudang Garam.*

