

ABSTRAK

AUNI LADUNNIYAH. 2023. *Prediksi Harga Saham Sektor Pertambangan di Jakarta Islamic Index (JII) untuk Membantu Trader Mengambil Keputusan Pembelian Saham Menggunakan Metode ARIMA.* Skripsi, Program Studi Ekonomi Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam. Pembimbing: Prof. Dr. H. Fathurrahman Azhari, M. H. I.

Kata Kunci: Batubara, Metode ARIMA, *Forecasting*

Batubara menjadi sumber daya mineral terbesar di Indonesia yakni mencapai 110 miliar ton serta memiliki cadangan sebesar 36 miliar ton hingga akhir 2021. Hasil pertambangan yang banyak digunakan sebagai sumber energi untuk kegiatan operasional, khususnya di sektor industri diberbagai negara salah satunya adalah batubara. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui prediksi harga saham pertambangan khususnya batubara yang ada di *Jakarta Islamic Index (JII)* dengan menggunakan metode ARIMA dalam memprediksi harga saham tersebut. Hasil dari penelitian ini diharapkan mampu menjadi referensi bagi para trader dalam mengambil keputusan jual-beli saham batubara PT. Adaro Energy, Tbk dan PT. Bukit Asam, Tbk.

Penelitian ini menggunakan jenis penelitian kuantitatif dengan metode deskriptif kuantitatif. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder berupa harga perutupan saham harian pada periode 2 Februari 2022-28 Februari 2023 untuk memprediksi harga saham selama 20 hari kedepan dimulai pada 1 Maret – 31 Maret 2023. Metode analisis data yang digunakan untuk memprediksi harga saham pada penelitian ini adalah menggunakan metode ARIMA.

Berdasarkan hasil penelitian diperoleh Model prediksi terbaik dengan menggunakan metode ARIMA berdasarkan beberapa uji yang telah dilakukan pada perusahaan PT. Adaro Energy, Tbk (ADRO) adalah model ARIMA (0,1,1), dan pada perusahaan PT. Bukit Asam, Tbk (PTBA) adalah model ARIMA (1,1,1). Hasil prediksi harga saham untuk 20 hari kedepan pada dua perusahaan tersebut mengalami kenaikan secara perlahan yang memberikan hasil harga prediksi mendekati dengan harga aktual.