# ABSTRAK

**Affivah Icha Anggareni (1209240009): Analisis Perbandingan Metode *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA) dan *Support Vector Regression* (SVR) Dalam Prediksi Harga Saham Pada Perusahaan LQ45 Tahun 2018-2022.**

Investasi di pasar saham memiliki risiko yang tinggi akibat fluktuasi harga saham, sehingga prediksi harga saham menjadi hal yang krusial bagi investor.

Penelitian ini bertujuan untuk membandingkan tingkat akurasi metode *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA) dab *Support Vector Reggression* (SVR) dalam memprediksi harga saham pada perusahaan indeks LQ45 Tahun 2018-2022. Data yang digunakan adalah harga saham bulanan dari lima perusahaan terpilih di indeks LQ45.

Metode ARIMA digunakan untuk menangkap pola linier dalam data deret waktu, sementara SVR digunakan untuk menangkap hubungan non-linear.

Hasil Penelitian menunjukkan bahwa metode SVR memiliki tingkat akurasi yang lebih tinggi dibandingkan ARIMA berdasarkan nilai *Root Mean Square Error* (RMSE). Dengan demikian, SVR direkomendasikan sebagai metode yang lebih unggul untuk memprediksi harga saham dalam indeks LQ45.



**Kata Kunci**: ARIMA, SVR, Prediksi Harga Saham, LQ45, RMSE



UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SUNAN GUNUNG DJATI
BANDUNG