

PREDIKSI HARGA SAHAM BANK BJB MENGGUNAKAN METODE REGRESI BERDASARKAN DATA HISTORIS *ADJ CLOSE*

**Oleh :
Cika Mulia Nisa**

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengembangkan model prediksi harga saham bank BJB menggunakan metode regresi berdasarkan data historis *adj close*. Harga saham yang disesuaikan (*adj close*) adalah harga saham yang telah disesuaikan dengan faktor-faktor seperti dividen dan pembagian saham tambahan. Data historis *adj close* memiliki kelebihan dalam memberikan gambaran yang lebih akurat mengenai pergerakan harga saham bank BJB. Metode regresi akan digunakan untuk memodelkan hubungan antara harga saham bank BJB (variable dependen) dengan faktor-faktor ekonomi atau variable independen, seperti indeks pasar saham, suku bunga, dan kinerja keuangan bank BJB.

Data historis *adj close* bank BJB serta data ekonomi terkait akan dikumpulkan dan dianalisis untuk membangun model regresi. Data akan dibagi menjadi dua bagian, yaitu data pelatihan dan data pengujian. Model regresi akan dikembangkan dengan menggunakan data pelatihan, dan kemudian akan digunakan untuk memprediksi harga saham bank BJB di masa depan menggunakan data pengujian. Performa model akan dievaluasi menggunakan metrik evaluasi seperti *Mean Absolute Error (MAE)*, *Root Mean Squared Error (RMSE)*, dan *Coefficient of Determination*.

Hasil dari penelitian ini diharapkan dapat memberikan kontribusi dalam memprediksi harga saham bank BJB dengan akurasi yang lebih tinggi berdasarkan data historis *adj close*. Penelitian ini juga dapat memberikan wawasan baru kepada investor dan pelaku pasar mengenai faktor-faktor ekonomi yang berpengaruh terhadap harga saham bank BJB menggunakan metode regresi.

Kata kunci : prediksi harga, metode regresi, *adj close*

PREDIKSI HARGA SAHAM BANK BJB MENGGUNAKAN METODE REGRESI BERDASARKAN DATA HISTORIS *ADJ CLOSE*

**Oleh :
Cika Mulia Nisa**

ABSTRACT

The objective of this study is to develop a stock price prediction model for Bank BJB using a regression method based on historical adjusted close data. The adjusted close price reflects the stock price that has been adjusted for factors such as dividends and stock splits. This data offers a more accurate representation of Bank BJB's stock price movements. The regression method will be used to model the relationship between Bank BJB's stock price (dependent variable) and various economic factors or independent variables, such as stock market indices, interest rates, and Bank BJB's financial performance.

Historical adjusted close data of Bank BJB, along with relevant economic data, will be collected and analyzed to build the regression model. The dataset will be divided into two parts: training data and testing data. The regression model will be developed using the training data and subsequently used to predict future stock prices of Bank BJB using the testing data. The model's performance will be evaluated using evaluation metrics such as Mean Absolute Error (MAE), Root Mean Squared Error (RMSE), and the Coefficient of Determination (R^2).

The results of this study are expected to contribute to more accurate predictions of Bank BJB's stock price based on adjusted close historical data. This research may also provide new insights for investors and market participants regarding the economic factors that influence Bank BJB's stock price using regression methods.

Keywords: price prediction, regression method, adjusted close