

ABSTRAK

Pasar modal merupakan salah satu pilihan investasi yang sekarang paling populer. Dalam pasar modal, prediksi harga saham merupakan isu yang penting bagi investor sehingga diperlukan suatu metode peramalan yang baik sebagai dasar pengambilan keputusan dalam bertransaksi. Salah satu metode peramalan yang umum digunakan adalah ARIMA. Namun, dalam pemodelan ARIMA diperlukan beberapa asumsi yang harus dipenuhi seperti asumsi stasioneritas, signifikansi parameter, serta asumsi *white noise*. Metode *Double Exponential Smoothing Holt* merupakan salah satu metode peramalan dengan asumsi yang harus dipenuhi hanyalah asumsi stasioneritas. Tujuan dari penelitian ini adalah mendapatkan model terbaik dengan menggunakan pendekatan analisis *time series* yaitu metode ARIMA dan *Double Exponential Smoothing Holt* untuk meramalkan harga saham *Jakarta Islamic Index* selama 10 periode di masa mendatang. Berdasarkan analisis yang telah dilakukan, peramalan harga saham *Jakarta Islamic Index* sebaiknya dilakukan menggunakan metode ARIMA dengan model ARIMA (1,1,0) karena memiliki nilai MAPE terkecil, yaitu 1,5292%.

Kata Kunci: Pasar Modal, Investasi, Peramalan, ARIMA, *Double Exponential Smoothing Holt*, *Time Series*