

ABSTRAK

Turunnya harga saham perusahaan PT GoTo Gojek Tokopedia Tbk paska berakhirnya periode *lock up* saham telah banyak diberitakan melalui berbagai media sosial. Banyak masyarakat yang menuangkan pendapat dan komentar melalui media sosial, yang merupakan sarana media digital dan dapat diakses oleh siapapun. Berbagai macam komentar dari masyarakat melalui media sosial dapat berupa komentar negatif atau komentar positif. Salah satu media sosial yang banyak digunakan masyarakat dalam memberikan komentar yaitu Twitter. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh dari sentimen masyarakat di media sosial terkait perusahaan GoTo terhadap perubahan harga saham perusahaan. Dengan menggunakan metode Naïve Bayes Classifier (NBC) data komentar diklasifikasikan ke dalam dua kelas, yaitu positif dan negatif. Hasil klasifikasi selanjutnya disajikan dalam tabel kontingensi berdasarkan periode naik atau turunnya harga saham. Pengujian pengaruh sentimen terhadap perubahan harga saham dilakukan menggunakan analisis korelasi menggunakan uji lambda. Klasifikasi data komentar menggunakan algoritma Naïve Bayes Classifier (NBC) menghasilkan akurasi sebesar 70% dengan rasio data latih dan data uji 70:30. Hasil analisis korelasi antara saham dan komentar menggunakan uji lambda diperoleh hasil *approximate significance* atau $p\text{-value}=0.739$ dan nilai koefisien korelasi $\lambda = 0.036$ serta diperoleh hasil bahwa tidak terdapat hubungan signifikan antara sentimen masyarakat dan perubahan harga saham PT GoTo Gojek Tokopedia Tbk.

Kata Kunci: Analisis Sentimen, Twitter, GoTo, Saham, Naïve Bayes Classifier, Analisis Korelasi, Uji Lambda.