

ABSTRAK

Gerakan boikot terhadap produk PT Unilever Indonesia Tbk akibat isu konflik Palestina-Israel menjadi latar belakang utama penelitian ini, mengingat dampaknya yang signifikan terhadap sentimen publik di Indonesia. Masalah utama yang dikaji adalah apakah sentimen masyarakat di media sosial Twitter memengaruhi fluktuasi harga saham perusahaan. Tujuan penelitian ini adalah untuk membangun model klasifikasi sentimen yang akurat, serta menganalisis hubungan antara sentimen publik dengan pergerakan harga saham Unilever. Penelitian ini menggunakan metode *Knowledge Discovery in Databases* (KDD), yang terdiri dari lima tahapan: *data selection*, untuk mengeksplorasi data dari Twitter dan harga saham dari Yahoo Finance; *data preprocessing* meliputi *preprocessing* dan memberi label kategori; *data transformation*, proses transformasi data dari teks menjadi numerik menggunakan TF-IDF; *data mining*, menggunakan algoritma Support Vector Machine (SVM) untuk proses pemodelan klasifikasi sentimen; *evaluation*, dengan pengukuran *accuracy*, *precision*, *recall*, dan *f1-score* serta implementasi model analisis sentimen. Hasil utama menunjukkan bahwa model SVM mampu mengklasifikasikan sentimen dengan akurasi tinggi, yaitu 85,99%. Meskipun demikian, uji statistik *chi-square* menghasilkan nilai sebesar 1,257 dengan *p-value* sebesar 0,533 dan nilai uji lambda sebesar 0,000 menunjukkan tidak adanya hubungan yang signifikan antara sentimen harian di Twitter dengan perubahan harga saham pada periode pengujian. Artinya, pengetahuan tentang sentimen harian tidak membantu mengurangi kesalahan dalam memprediksi pergerakan harga saham. Kesimpulannya, walaupun sentimen publik dapat dimodelkan secara efektif, dampaknya terhadap harga saham tidak terbukti signifikan secara statistik. Penelitian ini diharapkan dapat bermanfaat untuk manajemen reputasi perusahaan dan menekankan pentingnya analisis fundamental bagi investor di atas sentimen sesaat di media sosial.

Kata kunci: Harga Saham, Sentimen Analisis, Support Vector Machine, Uji Chi-Square, Uji Lambda.