

ABSTRAK

Investasi saham merupakan salah satu jenis investasi yang paling banyak digemari oleh masyarakat. Walaupun memiliki resiko yang besar namun investasi saham juga dapat memberikan *return* yang luar biasa. Hal ini yang membuat jumlah investor di Indonesia meningkat setiap tahunnya. Begitu pula dengan perkembangan penyebaran informasi. Kehadiran sosial media memungkinkan siapapun untuk dapat menyebarkan informasi. Hal ini menjadi tantangan, dimana informasi-informasi ini dapat memberikan pengaruh terhadap keputusan-keputusan yang akan diambil oleh seorang investor.

Pada penelitian ini dilakukan analisis untuk melihat korelasi antara sentimen yang terbentuk dari *tweet* di *Twitter* dengan *abnormal return* saham dari perusahaan-perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ45. Semua *tweet* yang dibuat pada periode Oktober - Desember 2019 dikumpulkan untuk diklasifikasikan berdasarkan sentimen positif negatif oleh model klasifikasi *Naïve Bayes*. Hasil klasifikasi sentimen ini kemudian di *ranking* dan dibandingkan dengan *abnormal return* saham dari perusahaan-perusahaan indeks LQ45 menggunakan metode uji korelasi *Rank Spearman*.

Hasil korelasi *Rank Spearman* menunjukkan bahwa sentimen memiliki pengaruh yang lemah terhadap *abnormal return* saham. Baik itu *return* pada hari yang sama, setelah 1 hari, atau setelah 5 hari sentimen itu terbentuk. Selain itu jumlah *followers* dari akun-akun di *Twitter* yang memberikan komentar mengenai perusahaan-perusahaan tersebut juga tidak memiliki pengaruh. Beberapa faktor lain diduga menjadi penyebab sentimen-sentimen tersebut diabaikan.

Kata Kunci: Analisis Sentimen, Klasifikasi *Naïve Bayes*, Korelasi *Rank Spearman*, *Tweet*, *Abnormal Return*.