

ABSTRAK

Investasi merupakan komitmen untuk menanamkan sejumlah dana pada saat ini untuk memperoleh keuntungan di masa mendatang. Seorang investor harus dapat mengambil keputusan secara tepat dalam berinvestasi untuk mendapatkan maksimal profit. Sehingga, informasi yang ada terkait investasi dibutuhkan untuk membantu para investor. Salah satu cara mendapatkan informasi dilakukan dengan cara mengakses berita. Pada Bursa Efek Indonesia (BEI) terdapat istilah indeks LQ45 yang terdiri atas 45 emiten dengan likuiditas tinggi yang dapat dijadikan salah satu referensi investor dalam menanamkan sahamnya.

Kehadiran *big data* dan kemudahan dalam mengakses informasi seperti berita menjadikan penelitian ini bertujuan untuk mengetahui sentimen yang terbentuk dari berita, melihat pergerakan *return* pada periode 2013 – 2018, serta melihat korelasi antara sentimen berita dan *return* saham. Dalam melihat sentimen ini, metode yang digunakan merupakan *sentiment analysis* dengan melakukan klasifikasi model *Naïve Bayes*. Kemudian, melakukan uji korelasi *rank spearman*.

Hasil dari penelitian ini dapat menunjukkan bahwa sentimen yang terbentuk pada berita di dominasi oleh sentimen positif yaitu sebanyak 72%. Sedangkan, untuk presentase untuk sentimen negatif adalah 28%. Kemudian, Pergerakan *return* saham pada periode Februari 2013 – Agustus 2018 adalah 46% menunjukkan sentimen positif. Sedangkan 42% menunjukkan sentimen negatif, dan 12% dinyatakan bahwa hubungan sentimen dan *return* tidak berpengaruh. Selanjutnya, uji korelasi *Rank Spearman* menunjukkan bahwa dari 20 objek perusahaan, 12 perusahaan memiliki korelasi kurang atau diabaikan, 7 perusahaan memiliki korelasi lemah, dan 1 perusahaan memiliki korelasi sedang.

Kata Kunci: Pasar Efisien, *Sentiment Analysis*, Korelasi *Rank Spearman*, *Naïve Bayes Classifier*