

ABSTRAK

VINCENT

03081170031

ANALISA *VALUE INVESTING* SAHAM PERBANKAN DENGAN MENGUNAKAN METODE *K-MEANS CLUSTERING*

(xiv + 51 halaman: 10 gambar, 22 tabel; 5 lampiran)

Seiring dengan perkembangan zaman, berbagai fasilitas dan kemudahan diberikan kepada masyarakat dalam mengakses industri pasar modal di Indonesia. Sebagai *investor* tentunya juga harus bisa menganalisis saham yang layak dibeli dan saham yang tidak layak dibeli karena ada lebih dari 700 perusahaan yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia. Salah satu metode yang umum dipakai investor untuk melakukan analisa *value investing* dimana membeli saham di bawah harga wajarnya atau sering disebut dengan saham yang *undervalue*, untuk kemudian dijual di harga wajarnya. Penelitian ini bertujuan membantu investor dalam mengelompokkan saham yang *undervalue* dengan memperhatikan parameter-parameter yang sering digunakan dalam metode *value investing*. Dalam penelitian ini saham yang digunakan merupakan saham sektor perbankan dan dikelompokkan menggunakan metode *K-Means Clustering*. Hasil penelitian membuktikan bahwa implementasi algoritma *k-means* pada data saham perbankan dengan atribut *Return on Equity (%)*, *Book Value (IDR)*, *Total Sales*, *Net Income & Net Cash Flow* berdasarkan hasil evaluasi nilai *davies bouldin index* yang berada pada rentang 0,029 hingga 0,061. Nilai tersebut memperlihatkan masing-masing anggota dalam *cluster* tersebut memiliki kesamaan yang cukup baik karena mendekati angka 0.

Kata Kunci: Pasar Modal, *Value Investing*, Saham Perbankan, *K-means Clustering*, Data Mining

Referensi: 23 (2014-2021)

ABSTRACT

VINCENT

03081170031

VALUE INVESTING ANALYSIS ON BANKING STOCK USING K-MEANS CLUSTERING METHOD

(xiv + 51 pages: 10 figures, 22 tables; 5 appendices)

Along with the times, various facilities and convenience are provided to the public to accessing the capital market industry in Indonesia. As an investor, of course, you must also be able to analyze the stocks that are worth buying and those that are not worth buying because there are more than 700 companies listed on the Indonesia Stock Exchange. One of the methods commonly used by investors to analyze value investing is to buy shares below their fair price or often referred to as undervalued shares, and then sell them at their fair price. This study is to assist investors in classifying undervalued stocks by using the parameters that usually used in the value investing method. In this study, the stocks used are banking sector stocks and are clustered using the K-Means Clustering method. The results of the study prove that the implementation of the k-means algorithm on banking stock data with the Return on Equity (%), Book Value (IDR) attribute, Total Sales, Net Income & Net Cash Flow based on the results of the evaluation of the Davies-bouldin index value which is in the range of 0.029 to 0.061. This value shows that each member in the cluster has a fairly good similarity because it is close to 0.

Keywords: *Capital Market, Value Investing, Banking Stock, K-means Clustering, Data Mining*

References: *23 (2014-2021)*