



Hak cipta dan penggunaan kembali:

Lisensi ini mengizinkan setiap orang untuk menggubah, memperbaiki, dan membuat ciptaan turunan bukan untuk kepentingan komersial, selama anda mencantumkan nama penulis dan melisensikan ciptaan turunan dengan syarat yang serupa dengan ciptaan asli.

Copyright and reuse:

This license lets you remix, tweak, and build upon work non-commercially, as long as you credit the origin creator and license it on your new creations under the identical terms.

BAB I

PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang

Investasi saham sudah menjadi pilar penting bagi perkembangan keuangan di sebuah perusahaan. Terlebih, harga saham yang ditampilkan oleh perusahaan sudah bisa diketahui oleh masyarakat dan para pengamat ekonomi karena perusahaan tersebut sudah *go public* di Bursa ekonomi Indonesia. Harga saham yang ditampilkan akan mendukung perkembangan keuangan di Indonesia.

Beberapa faktor yang mendukung perkembangan keuangan di Indonesia adalah faktor-faktor fundamental dan teknikal yang mempengaruhi harga pasar saham di sebuah perusahaan yang terdaftar di BEI (Bursa Efek Indonesia) (Ginting & Suriyany, 2013) serta faktor internal dan eksternal yang membuat fluktuasi saham menjadi tidak stabil (Rahmi, Mahmudy, & Setiawan, 2015). Pengaruh dari faktor-faktor tersebut mempengaruhi kualitas harga saham dalam sebuah perusahaan, sehingga dapat mengakibatkan harga yang fluktuatif. Harga yang berfluktuatif dapat mempersulit prediksi harga saham di periode ke depan.

Penelitian ini berfokus untuk menjawab permasalahan dalam memprediksi harga saham. Penelitian mengambil contoh kasus harga saham bank BCA 2015-2017. Metode yang akan digunakan dalam penelitian ini adalah *Regression Linear* yang didukung dengan perhitungan MAPE. Metode tersebut dilakukan karena metode ini akan mencari harga trending yang dicatat oleh suatu perusahaan. Program Microsoft Excel digunakan untuk melakukan perhitungan

MAPE (*Moving Average Percentage Error*) dengan hasil akhir per-bulan. Tools *SPSS 16.0* digunakan untuk melakukan data mining harga prediksi saham bank BCA tahun periode 2015-2017 menggunakan data excel yang sudah di *cleansing* dan siap diproses ke dalam tool *SPSS 16.0* dengan model *Regression Linear*.

1.2. Rumusan Masalah

Setelah mengetahui permasalahan di atas, berikut ini adalah rumusan masalah yang akan diteliti dalam skripsi ini adalah:

Bagaimana performa prediksi harga saham bank BCA pada tahun 2015-2017 menggunakan perhitungan *Regression Linear* berganda?

1.3. Batasan Masalah

Masalah yang akan dibahas adalah prediksi saham bank BCA periode tahun 2015 sampai 2017 menggunakan model *Linear Regression*. Data yang akan digunakan adalah data-data historis harga saham bank BCA yang bersumber dari Yahoo Finance pada tahun periode 2015 sampai dengan 2017.

1.4. Tujuan Penelitian

Tujuan dari penelitian yang akan dibuat adalah membuat prediksi harga saham perbankan dengan menggunakan perhitungan *Regression Linear* dalam kurun waktu 3 tahun periode (2015-2017).

1.5. Manfaat Penelitian

Manfaat yang didapat setelah melakukan penelitian ini, yaitu untuk investor, karena bisa mengetahui nilai peramalan prospek saham perusahaan bank BCA dalam kurun waktu 3 tahun periode (2015-2017) yang akan digunakan untuk melakukan investasi saham di sebuah perusahaan.

