

BAB I

PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah

Pada saat ini banyak masyarakat yang melakukan investasi untuk mendapatkan *passive income*. Investasi merupakan suatu komitmen penempatan dana pada satu atau beberapa objek investasi dengan harapan akan mendapatkan keuntungan di masa akan datang. Ada sejumlah jenis investasi yang umum dipilih oleh *investor* perseorangan, seperti deposito, tabungan, valuta asing, saham, reksadana, logam mulia, dan properti. Setiap jenis investasi tersebut memiliki kelebihan dan kekurangan masing-masing.

Hal ini dimanfaatkan oleh banyak perusahaan untuk memperoleh sumber daya keuangan melalui penawaran saham kepada masyarakat. Berinvestasi dalam bentuk saham dipercaya dapat memberikan keuntungan besar bagi para *investor*-nya. Hal ini tentu menjadi daya tarik tersendiri kepada pelaku bisnis untuk bergabung menjadi *investor* dengan harapan memperoleh keuntungan sebagai akibat terjadinya perubahan atas harga saham. Namun, perlu diingat bahwa saham merupakan jenis investasi yang memiliki potensi tingkat keuntungan dan kerugian yang lebih besar dibandingkan jenis investasi lainnya. Hal tersebut terjadi dikarenakan sulitnya memprediksi pergerakan harga saham yang cenderung bersifat fluktuatif (Hendarto, 2005). Apabila *investor* salah melakukan prediksi terhadap harga saham akan menimbulkan kerugian finansial yang signifikan, terlebih jika *investor* memiliki lembar saham yang cukup banyak pada emiten tersebut.

Untuk bisa memprediksi harga saham yang bersifat fluktuatif tersebut maka diperlukan sebuah peramalan harga saham pada periode mendatang. Salah satu metode yang dapat digunakan untuk meramalkan adalah metode ARIMA. Dengan adanya peramalan harga saham ini, diharapkan mampu membantu masyarakat dalam memprediksi harga saham beberapa emiten.

1.2 Perumusan Masalah

Berdasarkan latar belakang di atas, maka dapat dirumuskan permasalahannya yaitu bagaimana menentukan model ARIMA terbaik untuk peramalan harga saham EXCL, FREN, ISAT, dan TLKM.

1.3 Pembatasan Masalah

Adapun pembatasan masalah pada penelitian ini, yaitu :

1. Data mentah harga saham diambil dari emiten sektor telekomunikasi, diantaranya : EXCL, FREN, ISAT, dan TLKM. Data tersebut didapatkan dari situs *Yahoo Finance*.
2. Data harga saham yang digunakan dalam penelitian ini adalah data harga penutupan saham (*close price*). Karena, *close price* sangat penting bagi para investor yang dapat dijadikan acuan dalam menentukan tren pasar pada periode berikutnya. *Close price* mencerminkan seluruh aktivitas transaksi dalam satu hari (Adebiyi,dkk, 2014).
3. Periode data histori yang digunakan adalah harian, mulai dari 21 Februari 2014 sampai 19 Februari 2016. Dan, hasil peramalannya untuk 5 hari ke depan.

4. Faktor eksternal dari saham seperti tingkat inflasi, suku bunga, perekonomian nasional, kinerja emiten tidak mempengaruhi hasil peramalan.
5. Analisis peramalan harga saham menggunakan metode ARIMA dan menggunakan *software* Minitab 16.

1.4 Tujuan Penelitian

Tujuan dari penelitian ini adalah menghasilkan model ARIMA terbaik untuk peramalan harga saham EXCL, FREN, ISAT, dan TLKM.

1.5 Manfaat Penelitian

Berdasarkan tujuan penelitian di atas, maka manfaat dari penelitian ini adalah mampu membantu masyarakat dalam memprediksi harga saham EXCL, FREN, ISAT, dan TLKM.

1.6 Sistematika Penulisan

Penulisan laporan penelitian ini disusun dalam bentuk bab. Masing-masing bab memiliki beberapa sub bab. Berikut adalah penjelasan tentang bab maupun sub bab yang terdapat pada laporan penelitian ini :

BAB I : PENDAHULUAN

Bab ini berisi tentang latar belakang permasalahan yang terjadi, perumusan masalah yang didapat dari latar belakang permasalahan, pembatasan permasalahan, tujuan dan manfaat penelitian, serta penjelasan sistematika penulisan.

BAB II : LANDASAN TEORI

Bab ini berisi tentang teori-teori yang mendukung dan digunakan sebagai acuan pada saat atau sebelum melakukan penelitian, yaitu

tentang investasi, saham, teknik peramalan, metode ARIMA, dan metodologi penelitian.

BAB III : METODE PENELITIAN

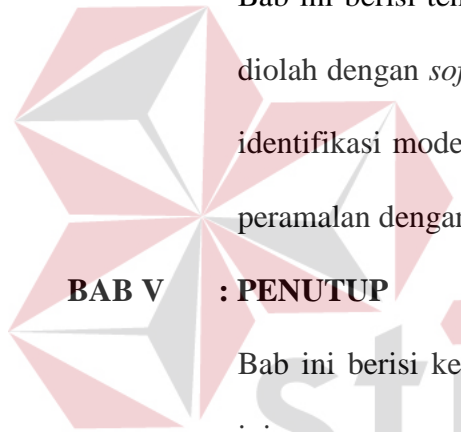
Bab ini berisi tentang langkah-langkah yang digunakan dalam penelitian, diantaranya jenis penelitian, sumber data, teknik pengumpulan data, studi literatur, blok diagram dan *flowchart* ARIMA, serta pengolahan data.

BAB IV : PEMBAHASAN DAN HASIL

Bab ini berisi tentang pembahasan dan analisis dari data yang telah diolah dengan *software* Minitab 16. Pembahasan dimulai dari proses identifikasi model, estimasi model, pengecekan model, dan uji coba peramalan dengan model ARIMA.

BAB V : PENUTUP

Bab ini berisi kesimpulan dan saran yang diperoleh dari penelitian ini.



INSTITUT BISNIS
& INFORMATIKA
stikom
SURABAYA