

Analisis perbandingan forecasting harga saham dengan metode artificial neural network dan metode box-jenkins : studi dalam forecasting harga saham LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2008-2012  
= A comparative analysis of forecasting stock price modelling using artificial neural network and box-jenkins method : a study of forecasting Indonesian LQ45 stock index listed in Indonesian Stock Exchange for the period of 2008-2012

Muhammad Adam Bachtiar, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20345686&lokasi=lokal>

---

Abstrak

Memprediksi Pergerakan Harga Saham selalu menjadi isu yang menarik dan memiliki implikasi yang signifikan dalam membuat keputusan investasi, khususnya di Bursa Efek Indonesia sebagai pasar yang menggeliat. Penelitian membahas prediksi pergerakan harga saham dengan menggunakan Artificial Neural Network (ANN) atau jaringan syaraf tiruan dan Box-Jenkins Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) di Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dan tergolong dalam studi eksplanatif. Rentang waktu yang digunakan ialah dari Januari 2008 hingga Desember 2012. Penelitian ini berusaha menganalisis signifikansi dari metode ANN dalam peramalan harga saham LQ45 di Indonesia.

Diharapkan hasil dari penelitian ini dapat membantu para investor dan pihak lain yang berkepentingan dalam memilih metode peramalan yang terbaik dan juga keputusan bisnis terbaik. Terdapat empat faktor yang dipilih sebagai variabel independen, yaitu Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), volume perdagangan harian tiap saham, kurs Rupiah terhadap Dollar Amerika dan harga minyak dunia. Penelitian ini menemukan bahwa metode ANN lebih signifikan dibandingkan dengan metode ARIMA dalam peramalan harga saham LQ45 di Indonesia.

.....Predicting Stock Price Movement is always considered as an interesting issues and has significant impacts in creating investment decision, particularly in the Indonesian Stock Exchange as an emerging market. This research discusses the prediction of stock price movements using Artificial Neural Networks (ANN) method and Box Jenkins Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) in Indonesian Stock Exchange.

This research is quantitative and explanation in nature. The time scope of this research was from January 2008 up to December 2012. This research intends to analyze the significant of ANN method in forecasting Indonesian LQ45 Stock prices.

It is expected that the results of this research might assist the investors and other interested parties in selecting best forecasting methods and also best investment decision. There are four factors selected as independent variables, such as: Indonesian Composite Index, trading volume of each stocks, local currency exchange rate to USD and oil spot price. The research reveals that ANN is statistically more significant compared.