

Perbandingan metode peramalan harga saham antara multiple regression method, winter's method dan arma

Bambang G. Indaryono, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20440638&lokasi=lokal>

Abstrak

Peramalan merupakan hal yang sangat penting dalam segala bidang, baik dalam menjalankan usaha maupun dalam penelitian. Semakin lama, semakin banyak metode-metode peramalan yang dikembangkan dalam memenuhi kebutuhan dalam meramal. Walau pengembangan metode peramalan semakin lama semakin maju, satu hal yang pasti adalah, tidak akan pernah ada metode peramalan yang dapat meramal secara tepat, peristiwa yang akan terjadi. Dari beberapa peramalan yang ada, ada beberapa metode yang banyak digunakan secara luas, baik dalam bisnis maupun dalam kehidupan sehari-hari. Peramalan tersebut antara lain adalah metode Regresi, metode Arima dan metode Winter.

Tesis ini mencoba untuk menemukan dari ketiga metode yang disebut diatas, mana diantara ketiga metode ini lebih baik bila diterapkan pada peramalan harga saham di bursa efek. Peramalan dilakukan dengan menggunakan harga saham beberapa perusahaan tertentu yang terdaftar di BEJ sejak tahun 1989, dan memenuhi syarat-syarat yang telah ditentukan agar harga saham dan perusahaan yang diramal terbebas dari faktor-faktor yang bersifat subjektif.

Setelah dilakukan peramalan, dan dengan menggunakan MSD (mean square deviation) sebagai alat untuk membandingkan antara ketiga metode tersebut, serta mempertimbangkan kelemahan dan kelebihan dari setiap metode dan juga daam proses pengumpulan data, ditemukan bahwa metode ARIMA, lebih baik dibanding dengan 2 metode lainnya. Metode ARIMA bukan tanpa kelemahan. Kelemahan utama adalah kesulitan untuk menentukan tingkat kepercayaan (r^2). r^2 tidak dapat ditentukan di awal analisa, tapi merupakan hasil yang didapat dari model yang ditemukan.