

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

Deskripsi Dokumen: <http://lib.ui.ac.id/opac/ui/detail.jsp?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.