BAB 1
PENDAHULUAN

1.1 Latar belakang

Peramalan (*forecasting*) adalah perkiraan sesuatu yang belum terjadi. Dalam ilmu pengetahuan sosial segala sesuatu itu serba tidak pasti, sukar diperkirakan secara tepat. Dalam hal ini diperlukan forecasting. Peramalan dilakukan berdasarkan data yang terdapat selama masa lampau yang dianalisis dengan menggunakan cara-cara tertentu. Baik tidaknya hasil dari suatu penelitian sangat ditentukan oleh ketepatan ramalan yang dibuat.

Peran pasar modal atau saham dalam perekonomian Indonesia mulai melembaga. Saat ini pembelian saham menjadi salah satu pilihan modal yang sah, selain bentuk modal lainnya seperti uang, tanah, dan emas. Faktor-faktor rasional dan berbagai faktor tidak rasional menjadi faktor penentu dalam pembelian saham. Faktor rasional umumnya berkaitan dengan analisis fundamental. Analisis ini difokuskan dan dilakukan terhadap aspek fundamental seperti laba per saham, deviden per saham, struktur permodalan, potensi pertumbuhan, dan prospek usaha perusahaan dari perusahaan yang memasuki pasar modal. (Setiawan, 2008).

PT Semen Indonesia (Persero) Tbk Pada tahun 1991, Perseroan mencatatkan diri sebagai perusahaan BUMN pertama yang Go Public di Bursa Efek Surabaya dan Bursa Efek Jakarta (sekarang menjadi Bursa Efek Indonesia), dengan kode emiten SMGR. yang sebelumnya bernama PT Semen Gresik (Persero) Tbk merupakan Badan Usaha Milik Negara (BUMN) yang bergerak di bidang industri bahan bangunan. Perseroan berperan sebagai Strategic Holding Company dengan berbagai lini usaha yang menawarkan solusi lengkap dalam pembangunan. Diresmikan pada tanggal 7 Agustus 1957 oleh Ir Soekarno Presiden pertama Republik Indonesia, Perseroan menjadi penopang pembangunan Indonesia pada masa awal kemerdekaan hingga saat ini.

Pada pasar modal atau dunia saham yang sempurna dan efisien, harga saham mencerminkan semua informasi yang tersedia secara umum di bursa maupun informasi yang hanya dapat diperoleh dari golongan-golongan tertentu. Tinggi

rendahnya harga saham dipengaruhi oleh banyak faktor seperti kondisi dan kinerja perusahaan, risiko, deviden, tingkat suku bunga, kondisi perekonomian, kebijaksanaan pemerintah, laju inflasi, penawaran dan permintaan serta masih banyak lagi. Karena dimungkinkan adanya perubahan faktor-faktor di atas, harga saham dapat naik atau turun. Prospek investasi saham sebuah perusahaan di masa datang dapat menentukan banyaknya ketertarikan investor untuk menanamkan modal pada perusahaan.

Untuk meningkatkan ketertarikan investor-investor baru ke dalam perusahaan, salah satu cara yang bisa dilakukan adalah dengan melakukan peramalan harga saham, peramalan disini akan sangat bermanfaat bagi investor untuk mengantisipasi naik-turunnya harga saham. Dengan adanya peramalan harga saham, akan sangat membantu para investor di dalam pengambilan suatu keputusan. Penelitian ini menggunakan tiga jenis metode antara lain *single exponential smoothing*, Metode Dua Parameter dari Holt's, dan Metode Linier Satu Parameter dari Brown's. Ketiga metode ini sama-sama termasuk dalam lingkup *exponential smoothing*, karena data yang digunakan berupa data harian maka disesuaikan dengan metode peramalan jangka pendek, dan saat dilakukan perbandingan, cara perhitungannya pun tidak akan terlalu berbeda jauh dan juga data harga saham yang digunakan kecil kemungkinannya menunjukkan adanya perilaku musiman. Oleh karena itu, 3 metode cocok digunakan dikarenakan tidak memerlukan adanya perilaku musiman.

Dalam penelitian ini akan dilakukan peramalan data harga saham untuk mencari metode peramalan terbaik dengan menggunakan perbandingan 3 metode berbeda dengan data pada PT. Semen Indonesia, dan metode *Mean Absolute Deviation* (MAD), *Mean Squared Error* (MSE), *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE) untuk mencari peramalan dengan tingkat eror terkecil.

1.2 Perumusan masalah

Dari latar belakang yang terurai diatas, maka dapat diambil permasalahan yaitu :

1. Bagaimana memperhitungkan peramalan dengan menggunakan perbandingan 3 metode berbeda ?

2. Bagaimana menentukan metode peramalan terbaik dari perbandingan hasil peramalan dengan nilai kesalahan atau eror terkecil ?

1.3 Tujuan Penelitian

1. Memperhitungkan peramalan harga saham dengan menggunakan perbandingan 3 metode berbeda.
2. Mencari metode peramalan terbaik dalam memperhitungkan harga saham dengan menggunakan perbandingan hasil peramalan 3 metode menggunakan hasil evaluasi *Mean Absolute Deviation* (MAD), *Mean Squared Error* (MSE), *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE).

1.4 Batasan Penelitian

Untuk batasan masalah pada penelitian ini adalah sebagai berikut:

1. Penelitian ini dibuat untuk mencari metode peramalan terbaik dengan menggunakan perbandingan 3 metode peramalan yaitu *single exponential smoothing*, metode Linier Satu Parameter dari Brown, dan metode Dua Parameter dari Holt, dan Metode untuk evaluasi yaitu *Mean Absolute Deviation* (MAD), *Mean Squared Error* (MSE), dan *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE) untuk mencari tingkat kesalahan atau eror terkecil.
2. Lingkup penelitian analisis peramalan harga saham hanya berfokus pada data PT. Semen Indonesia.
3. Data yang digunakan adalah data harga saham harian mulai dari 1 Januari 2016 sampai dengan 30 Juni 2019.

1.5 Manfaat penelitian

1. Perusahaan

   Sebagai sumber informasi agar mempermudah pihak investor untuk memperkirakan atau meramalkan harga saham untuk periode yang akan datang, Sebagai bahan evaluasi untuk pihak perusahaan terkait data harga saham dimasa mendatang.

2. Penulis

   Menambah pengalaman dan pengetahuan yang lebih luas mengenai peramalan dan saham.