

**ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN
ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020**

SKRIPSI



Disusun oleh

PERMADI

NPM. 17610127

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FALKUTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH METRO

2021



**ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN
ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020**

SKRIPSI

**Diajukan
Untuk Memenuhi Salah Satu Persyaratan
Dalam Menyelesaikan Program Sarjana Manajemen**

**Oleh:
PERMADI
17610127**

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH METRO
2021**

ABSTRAK

ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020

Permadi¹,Febriyanto², Nani Septiana³

Universitas Muhammadiyah, Kota Metro, Lampung

E-mail : permadia360@gmail.com

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk memberikan informasi kepada investor dengan metode *Doble Moving Average* untuk mempengaruhi pengambilan keputusan pembelian harga saham. Sifat saham yang fluktuatif atau berubah – ubah, oleh sebab itu dilakukan peramalan indeks harga saham. Penelitian ini menggunakan metode peramalan *Doble Moving Average*. Untuk mengevaluasi Teknik peramalan menggunakan MAPE (*Mean Absolute Percentage Error*), MAD (*Mean Absolute Deviation*) dan MSD (*Mean Squared Deviation*). Jenis penelitian ini merupakan penelitian kualitatif dengan populasi penelitian 16 perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI), hanya 4 sampel yang digunakan yang sesuai dengan yang ditetapkan oleh peneliti dan hanya lima tahun penelitian dilakukan yaitu pada periode 2016-2020. Data perusahaan dilihat dari data historis atau data aktual dan diujicobakan menggunakan software Minitab versi19.

Hasil dari perhitungan menggunakan metode *Doble Moving Average* untuk nilai kesalahan (*error*) terkecil dari empat perusahaan asuransi periode 2016-2020 dapat disimpulkan bahwa perusahaan yang sedikit nilai kesalahan nya (*error*) yaitu perusahaan AMAG (Asuransi Multi Artha Guna Tbk) dengan nilai MAPE = 6,663, MAD = 23,333, dan MSD = 977748.

Kata kunci : Peramalan, Indeks Harga Saham, *Doble Moving Average*, MAPE,MAD,MSD.

ABSTRACT

FORECASTING ANALYSIS OF STOCK PRICE INDEX IN INSURANCE COMPANIES IN INDONESIA STOCK EXCHANGE (IDX) 2016-2020

Permadi¹,Febriyanto², Nani Septiana³

Muhammadiyah University, Metro City, Lampung

E-mail : permadia360@gmail.com

ABSTRACT

This study aims to provide information to investors with the Double Moving Average method to influence stock price purchasing decisions. The nature of the stock is fluctuating or changing, therefore the stock price index forecast is carried out. This study uses the Doble Moving Average forecasting method. To evaluate the forecasting technique using MAPE (Mean Absolute Percentage Error), MAD (Mean Absolute Deviation) and MSD (Mean Squared Deviation). This type of research is a qualitative research with a research population of 16 companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX), only 4 samples used are in accordance with those set by the researchers and only five years of research were carried out, namely in the 2016-2020 period. Company data is seen from historical data or actual data and tested using Minitab software version 19.

The results of calculations using the Doble Moving Average method for the smallest error value of the four insurance companies for the 2016-2020 period can be concluded that the company with the least error value is the AMAG company (Multi Artha Guna Insurance Tbk) with a MAPE value. = 6,663, MAD = 23,333, and MSD = 977748.

Keywords : Forecasting, Stock Price Index, Doble Moving Average, MAPE, MAD, MSD.

HALAMAN PENGESAHAN

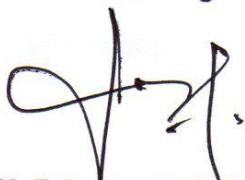
ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020

SKIPSI

PERMADI
17610127

Telah Disetujui Oleh:

Dosen Pembimbing I



Dr. H. Febriyanto, S.E., M.M.
NIDN. 0223027901

Dosen Pembimbing II



Nani Septiana, S.E., M.M.
NIDN. 0220098901

Mengetahui :

Kaprodi S1 Manajemen



Dr. H. Febriyanto, S.E., M.M.
NIDN. 0223027901

HALAMAN PERSETUJUAN

ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN
ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020

PERMADI

NPM.17610127

Telah diuji dan dinyatakan lulus pada:

Hari : Rabu

Tanggal : 25 Agustus 2021

Tempat Ujian : Ruang Sidang FEB UM Metro

Tim Penguji,


Dr. H. Febriyanto, S.E., M.M.
NIDN. 0223027901

Ketua Penguji


Nani Septiana, S. E., M. M.
NIDN. 0220098901

Sekretaris


Yateno, S. E., M. M.
NIDN. 0225046502

Penguji Utama

Mengetahui,
Dekan

H. Suwarto, S.E., M.M.
NIDN. 0210036801

MOTTO

Allah tidak membebani seseorang melainkan sesuai dengan kesangupannya. Dia mendapat (pahala) dari kebijakan yang dikerjakannya dan dia mendapat (siksa) dari (kejahatan) yang di buatnya.

(QS. Al-Baqarah:286)

Sesungguhnya bersama kesulitan pasti ada kemudahan. Maka apabila engkau telah selesai (dari sebuah urusan) tetaplah berkerja keras (untuk urusan yang lain).

(QS. Al-insyirah:6-7)

Yakinlah proses tidak menghianati hasil.

(Penulis)

PERSEMBAHAN

Dengan mengucapkan rasa syukur kepada Allah SWT, yang telah memberikan rahmat dan hidayahnya kepada penulis, maka dengan kerendahan hati skripsi ini penulis mempersembahkan kepada:

1. Kedua orang tua saya Bapak Salim dan Ibu Sutarmi, yang telah membesarkan dengan kasih sayang dan cinta yang luar biasa, membimbing, mendukung dan mendoakan keberhasilanku.
2. Keluarga besarku yang memberi semangat, dan dukungan moral, sehingga penulis dapat menyelesaikan sekripsi ini.
3. Kepada teman, sahabat, dan sodaraku, dian mulyawan, Aldo , irwan juliato, yuda, andika, andri, beni, andre, roby, meylinda, Layla, telah memberi dukungan dan dorongan sekaligus motifasi yang telah mereka berikan kepada saya sehingga saya menjadi lebih giat dan rajin dalam mengerjakan skripsi hingga selesai.
4. Almamater Universitas Muhammadiyah Metro yang saya bangakan.

KATA PENGANTAR

الحمد لله رب العالمين

Alhamdulillah, puji syukur kehadirat Allah SWT atas rahmat dan hidayah-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul "**ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020**". Shalawat serta salam disampaikan kepada junjungan kita Nabi Muhammad SAW, semoga mendapat syafaatnya dihari akhir kelak.

Penyelesaian skripsi ini tidak terlepas dari bantuan, dukungan, dan kerja sama dari berbagai pihak. Oleh karena itu, penulis menyampaikan terima kasih kepada:

1. Drs. H. Jazim Ahmad, M.Pd. Rektor Universitas Muhammadiyah Metro.
2. H. Suwarto, S.E., M.M. Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Metro.
3. Dr. H. Febriyanto, S.E., M.M. Ketua Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Metro serta dosen pembimbing I.
4. Nani Septiana, S.E., M.M. Dosen pembimbing II yang telah meluangkan waktu, memberikan saran, pengarahan dan bimbingan selama menyusun proposal ini.
5. Bapak dan Ibu Dosen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Metro yang telah memberikan ilmu yang bermanfaat.
6. Teman-teman seangkatan dan semua pihak yang namanya tidak disebutkan satu persatu.

Penulis menyadari akan keterbatasan pengetahuan, keterampilan dan kekurangan dalam pembuatan skripsi. Oleh karena itu, penulis mengharapkan saran dan kritik yang bersifat membangun yang dapat dijadikan sebagai bahan masukan bagi penulis demi kesempurnaan skripsi ini.

Penulis


PERMADI
NPM. 17610127

PERNYATAAN TIDAK PLAGIAT

Saya yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : Permadi
NPM : 17610127
Program Studi : Manajemen
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis

Dengan ini peneliti menyatakan bahwa skripsi yang berjudul "ANALISIS PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020" Adalah benar hasil karya tulisan saya sendiri dan tidak merupakan plagiat dari karya orang lain, yang merupakan salah satu syarat dalam penyelesaiannya program S-1 pada program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Metro.

Semua sumber data dan informasi yang saya gunakan dan saya peroleh dalam skripsi saya ini telah nyatakan dengan jelas dan benar adanya sesuai dengan peraturan berlaku. Apabila dikemudian hari pernyataan ini tidak benar saya bersedia menerima sanksi yang ditetapkan oleh universitas.

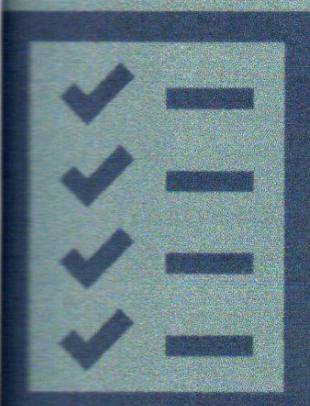
Metro, 6 September 2021



Permadi
NPM. 17610127



UNIT PUBLIKASI ILMIAH
VERSITAS MUHAMMADIYAH
METRO



SURAT KETERANGAN UJI KESAMAAN (SIMILARITY CHECK)

Nomor: 2521/II.3.AU/F/UPI-UK/2021

Unit Publikasi Ilmiah Universitas Muhammadiyah Metro dengan ini menerangkan bahwa:

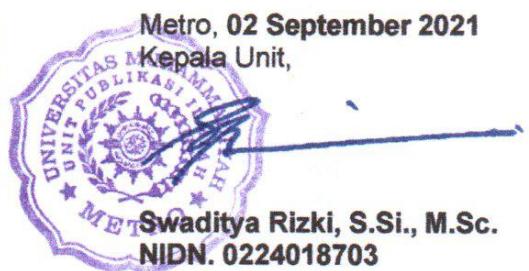
NAMA : PERMADI
NPM : 17610127
JENIS DOKUMEN : SKRIPSI

JUDUL:

ANALISI PERAMALAN INDEKS HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN ASURANSI DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) TAHUN 2016-2020

Telah dilakukan validasi berupa Uji Kesamaan (*Similarity Check*) dengan menggunakan aplikasi Turnitin. Dokumen yang telah diperiksa dinyatakan telah memenuhi syarat bebas uji kesamaan (*similarity check*) dengan persentase kesamaan $\leq 20\%$. Hasil pemeriksaan uji kesamaan terlampir.

Demikian kami sampaikan untuk digunakan sebagaimana mestinya.



Metro, 02 September 2021
Kepala Unit,

Swaditya Rizki, S.Si., M.Sc.
NIDN. 0224018703

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
LEMBAR LOGO	ii
HALAMAN JUDUL	iii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
HALAMAN PENGESAHAN	vi
HALAMAN PERSETUJUAN	vii
HALAMAN MOTTO	viii
HALAMAN PERSEMBAHAN	ix
KATA PENGANTAR	x
SURAT PERNYATAAN TIDAK PLAGIAT	xi
KETRANGAN HASIL UJI KESAMAAN (<i>SIMILARITY CHECK</i>)	xii
DAFTAR ISI	xiv
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR GAMBAR	xvii
DAFTAR LAMPIRAN	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	5
C. Tujuan Penelitian	5
D. Kegunaan Penelitian.....	6
 BAB II KAJIAN TEORITIK	
A. Kajian Literatur	6
1. Pasar Modal	6
2. Manfaat Pasar Modal.....	6
3. Teori Investasi.....	7
4. Indeks Harga Saham	8
5. Pengertian Peramalan	10
6. Tujuan Peramalan Indeks Harga Saham	11
7. Jenis - jenis Peramalan	12
8. Langkah – langkah Peramalan Indeks Harga Saham	12
9. Macam – macam Pola Data	13
10. Metode Peramalan.....	15
11. Metode Peramalan Kuantitatif	15
12. Evaluasi Metode/teknik peramalan.....	19
B. Penelitian Relevan	21
C. Kerangka Pemikiran.....	23
 BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis Penelitian	24
B. Objek dan Lokasi Penelitian	24
C. Metode Penelitian	24
1. Populasi	25

2. Sampel	25
D. Teknik Pengumpulan Data	26
E. Alat Analisis Data.....	26
1. Model Seri Waktu (<i>Time Series</i>).....	27
a. Metode Rata – rata Bergerak (<i>Moving Average Method</i>).....	27
2. Evaluasi Metode/Tehnik Peramalan.....	30
F. Pengujian Persyaratan Instrumen	32
a. Uji Normalitas.....	32
1. Uji <i>Kolmogorov-smimnov</i>	32
G. Pengujian Persyaratan Analisis	32
1. Auto Korelasi.....	32

BAB IV PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum Objek Penelitian	33
1. Sejarah Singkat Objek Penelitian	33
2. Struktur Organisasi	35
B. Hasil Penelitian.....	37
1. Statistic Deskriptif.....	37
a. Stasioneritas dalam <i>Varians</i>	38
b. Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	41
2. Metode Peramalan Dan Uji Asumsi.....	45
C. Pembahasan	52

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan.....	54
B. Saran	54

DAFTAR LITERATUR

LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT HIDUP

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
1. Perusahaan Asuransi yang terdaftar di BEI	2
2. Hasil Penelitian Relevansi	21
3. Populasi Perusahaan Asuransi di BEI Tahun 2016-2020.....	25
4. Daftar Perusahaan yang Menjadi Sampel.....	26
5. Daftar Perusahaan Yang Menjadi Sampel Sektor Asuransi Dalam Priode Penelitian 2016-2020.....	35
6. Statistik Deskriptif Perusahaan Asuransi	37
7. Rekap Pemeriksaan Stasioneritas dalam <i>Varians</i>	40
8. Perbandingan MAPE, MAD, dan MSD	52

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Halaman
1. Pergerakan Harga Empat Indeks Saham Perusahaan Asuransi	4
2. Kerangka Pemikiran	23
3. Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia	37
4. Plot <i>Time Series</i> ke Empat Perusahaan Asuransi.....	38
5. Kurva I <i>Box-Cox Transformation</i>	39
6. Kurva II <i>Box-Cox Transformation</i>	39
7. Kurva III <i>Box-Cox Transformation</i>	40
8. Kurva IV <i>Box-Cox Transformation</i>	41
9. Kurva V Plot ACF.....	41
10. Kurva VI Plot ACF.....	42
11. Kurva VII Plot ACF	43
12. Kurva VIII Plot ACF	43
13. Kurva IX Time Series.....	44
14. Kurva X Time Series.....	44
15. Kurva XI Time Series.....	45
16. Kurva XII Time Series.....	46
17. Kurva XIII Moving Average.....	46
18. Uji Kenormalan	47
19. Uji Kerandoman Residual.....	48
20. Kurva XIV Moving Average	48
21. Uji Kenormalan	49
22. Uji Kenormalan Residual.....	49
23. Kurva XV Moving Average	50
24. Uji Kenormalan	50
25. Uji Kerandoman Residual.....	51
26. Kurva XVI Moving Average	51
27. Uji Normalitas	51
28. Uji Kerandoman Residual.....	52