

ABSTRAK

Annisa Nur 'Azizah. NPM.16610135, Analisis Peramalan Indeks Harga Saham Pada Perusahaan Konstruksi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019 . Prodi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Metro. Pembimbing (I) Dr. Bambang Suhada, S.E., M.Si. Pembimbing (II) Karnila Ali, B.BUS., M.PA.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui metode apa yang sesuai untuk meramalkan Indeks Harga Saham Pada Perusahaan Konstruksi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019. Dengan pemilihan model yang sesuai dengan data deret waktu yang ada, untuk mengevaluasi hasil peramalan tersebut maka peneliti menggunakan ukuran ketepatan dengan *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE), *Mean Absolute Deviation* (MAD), dan *Mean Squared Deviation* (MSD). Jenis penelitian merupakan penelitian kuantitatif dengan populasi penelitian 16 perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia, hanya 4 sampel yang digunakan yang sesuai dengan kriteria yang telah ditentukan dan hanya lima tahun penelitian yang dilakukan yaitu pada periode 2015 sampai 2019. Data perusahaan dilihat dari data historis atau data aktual dan di Uji dengan menggunakan *software* Minitab versi 19.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa metode yang dapat digunakan untuk peramalan Indeks Harga Saham Perusahaan Konstruksi adalah Metode *Double Exponential Smoothing (Holt's)* dan Metode *Double Moving Average*. Perolehan nilai *error* yang paling kecil dari ke empat perusahaan konstruksi yaitu perusahaan WSKT dengan MAPE = 7.3, MAD = 148.8, dan MSD = 40506.0 untuk metode *Holt's* dan MAPE = 5.3, MAD = 110.1, dan MSD = 22006.9 untuk metode *Double Moving Average*.

Kata Kunci : Peramalan, Indeks Harga Saham, *Double Exponential Smoothing (Holt's)*, *Double Moving Average*, MAPE, MAD, MSD.