

# BAB I

## PENDAHULUAN

### 1.1 Latar Belakang

Manfaat pasar modal terhadap perekonomian suatu negara yaitu menjalankan fungsi ekonomi dan fungsi keuangan. Fungsi ekonomi pasar modal di antara lain mempertemukan investor, dengan perusahaan. Sedangkan fungsi keuangan pasar modal di antara lain memberikan kesempatan investor untuk mendapatkan imbalan (*return*). Pada pasar modal juga sangat banyak sekali yang diperdagangkan, salah satunya adalah saham. Untuk meminimalisir kerugian yang didapat investor dalam penanaman saham, terdapat sebuah upaya dalam pembelajaran pergerakan harga saham setiap harinya di pasar modal yaitu dengan cara teknik analisis [1]. Ada 2 macam teknik analisis yaitu analisis teknis dan analisis fundamental. Dengan menggunakan analisis teknis, investor dapat mengetahui dan memprediksi harga pada masa yang akan datang berdasarkan data harga saham harian sebelumnya. Sedangkan analisis fundamental ialah analisa yang didasarkan dengan kondisi suatu perusahaan, kondisi ekonomi dan industri terkait. Analisis fundamental pada umumnya menggunakan indikator-indikator perusahaan yang tertera melalui laporan keuangan perusahaan [2].

Program pada Tugas Akhir ini menggunakan analisis teknis dengan indikator teknis. Pada analisis teknis, ada banyak kategori indikator yang digunakan. Seperti contohnya adalah *Money Flow Index*, *Bollinger Band*, *Commodity Channel Index*, *Stochastic Oscillator*. Penggunaan kategori indikator ini bisa mengetahui kondisi pasar apakah dalam kondisi *uptrend* maupun *downtrend*. Setiap analisis mempunyai kelebihan masing-masing. Dipilihnya analisis teknis karena metode ini baik untuk menganalisa kondisi pasar yang sedang terjadi dan berinvestasi dalam kurun waktu yang pendek.

Dikarenakan tidak semua masyarakat dapat memahami dan mengerti secara langsung mengenai analisis teknis dengan mudah. Maka, dilakukanlah penelitian

guna pembuatan sebuah program rekomendasi pembelian dan penjualan saham yang bisa membantu seseorang dalam menentukan sinyal jual dan sinyal beli pada suatu saham dan dapat mengetahui profit tertinggi dari saham menggunakan indikator tertentu. Sehingga dengan dibuatnya program tersebut dapat memaksimalkan keuntungan yang diperoleh dari trading saham.

## **1.2 Batasan Masalah**

1. Data transaksi saham yang akan digunakan adalah data transaksi saham dan yang didapat dari situs penyedia data transaksi saham *API Yahoo Finance*.
2. Data yang digunakan memiliki interval 1 hari dengan periode rentang waktu pada tahun 2019.
3. Data pergerakan harga saham dalam bentuk transaksi harian.
4. Data saham yang digunakan berjumlah 30 saham.

## **1.3 Rumusan Masalah**

Berdasarkan latar belakang yang telah diuraikan, maka dapat dirumuskan beberapa masalah yang harus dihadapi sebagai berikut:

1. Bagaimana proses implementasi analisis teknis dengan menggunakan indikator teknis pada sistem pergerakan harga saham?
2. Bagaimana hasil rekomendasi jual beli dan profit dengan menggunakan indikator teknis?
3. Bagaimana cara mengetahui indikator terbaik untuk melakukan penganalisaan saham?

## **1.4 Tujuan dan Manfaat**

Berdasarkan rumusan masalah yang telah diuraikan, maka didapatkan tujuan dari penelitian sebagai berikut:

1. Dapat mengimplementasikan analisis teknis dengan indikator teknis pada sistem pergerakan harga saham.
2. Dapat mengetahui hasil rekomendasi jual beli dan profit dengan menggunakan indikator teknis.

3. Mengetahui indikator terbaik untuk melakukan pengenalisaan saham.

## 1.5 Metode Penelitian

Metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini terdiri atas 6 tahap, yaitu:

1. Studi Literatur

Studi literatur dilakukan dengan mencari referensi yang membahas saham terutama analisis teknis sehingga dapat menciptakan suatu program yang bisa memprediksi pergerakan harga saham.

2. Pengumpulan Data

Data yang digunakan pada penelitian diperoleh melalui sumber online dari situs bursa saham, yang menjadi acuan yaitu harga *open, high, low, close, dan volume*.

3. Analisa dan Perancangan

Dalam tahap ini dilakukan perancangan terhadap konsep analisis teknis dengan indikator teknis dan melakukan analisis terhadap data riwayat saham kemudian merancang sistem yang dapat melakukan rekomendasi jual atau beli terhadap suatu saham.

4. Implementasi Sistem

Mengimplementasikan hasil analisis juga perancangan sistem kedalam sebuah aplikasi prediksi pergerakan harga saham.

5. Pengujian Sistem

Pengujian dilakukan dengan melihat hasil prediksi pergerakan harga saham yang dihasilkan oleh program yang dibangun terhadap harga nyata saham dimasa depan. Selain itu juga dilakukan pengujian per-layer, per-fraksi, per-kombinasi, dan per-saham.

6. Penyusunan Laporan

Menyusun dokumentasi berupa laporan penelitian berdasarkan langkah-langkah yang telah dilakukan dalam proses pembuatan sistem agar dapat memberikan manfaat bagi pihak tertentu.

## **1.6 Sistematika Penulisan**

Sistematika Penulisan berisi gambaran besar penulisan laporan Tugas Akhir terdiri dari lima bab untuk mempermudah dalam memahami isi dari laporan Tugas akhir, dengan penjelasan sebagai berikut:

1. Bab I Pendahuluan

Pada bab ini dijelaskan mengenai latar belakang masalah yang mendasari adanya penelitian ini, identifikasi masalah, rumusan masalah, tujuan, metodologi, serta sistematika penulisan.

2. Bab II Tinjauan Pustaka

Pada bab ini dijelaskan mengenai penjelasan materi yang digunakan dalam penelitian ini, termasuk formula dari setiap indikator yang digunakan

3. Bab III Perancangan Sistem

Pada bab ini dijelaskan tentang rancangan sistem yang dibuat dalam penelitian yang dilakukan, antara lain perancangan sistem pengambilan data, perancangan pemrosesan data, perancangan pengambilan keputusan.

4. Bab IV Pengujian Sistem

Pada bab ini dijelaskan mengenai hasil pengujian sistem yang dilakukan pada sistem. Terdapat empat pengujian diantaranya pengujian per-fraksi, pengujian per-layer, pengujian kombinasi, dan pengujian saham.

5. Bab V Penutup

Pada bab ini dijelaskan mengenai kesimpulan dari hasil pengujian pada bab sebelumnya, serta saran untuk pengembangan program.