

Prediksi Return Saham Pada Saham Indeks LQ45 Menggunakan Regresi Linear Univariat

Muhammad Ghifari Arfananda¹, Dr. Deni Saepudin², S.Si., M.Si²,

^{1,2}Fakultas Informatika, Universitas Telkom, Bandung

¹mghifariarfananda@student.telkomuniversity.ac.id, ²denisapeudin@telkomuniversity.ac.id

Abstrak

Saham adalah salah satu instrumen pasar keuangan yang paling dikenal oleh masyarakat dengan sifatnya yang memiliki kemungkinan untuk mendapatkan keuntungan atau kerugian dalam jumlah yang besar dari menginvestasikan uang ke dalam suatu saham, atau bisa juga disebut dengan high risk dan high reward. Hal tersebut dikarenakan adanya fluktuasi harga saham yang sulit untuk diprediksi, di dalam saham, pastinya terdapat return pada saham, maksudnya yaitu imbalan hasil atas investasi saham yang dilakukan. Maka dari itu perlu diadakan prediksi pada return saham, hal ini dapat diyakini bahwa dalam memprediksi return saham kita dapat mengetahui bagaimana prediksi kedepannya berdasarkan dari hari sebelumnya.

Kata kunci : Return saham, Indeks LQ45, Univariate Predictive Regression Model, Forecast Evaluation

Abstract

Stock is one of the financial market instruments that mostly known by the public that has possibility to gain or lose profit in large amount from investing money in a stock, or also known as high risk and high reward. This is due to the fluctuations in stock prices that are difficult to be predicted. In stock, there must be a return, meaning that the result from the money they have invested. Therefore, it is necessary to predict the return stock, so we can acknowledge to predict the price based from the previous day.

Keywords : Stock return, LQ45 Index, Univariate Predictive Regression Model, Forecast Evaluation