

Abstrak

Saham merupakan bukti kepemilikan suatu perusahaan, kepemilikan saham berarti seseorang tersebut telah ikut serta dalam pemodalan suatu perusahaan. Para investor menginginkan return yang tinggi untuk setiap saham yang dimiliki, sehingga dibutuhkan model prediksi terhadap return saham. Technical indicator adalah sebuah teknik yang digunakan para investor yang digunakan untuk menganalisis maupun membaca pergerakan dari suatu saham. Diketahui bahwa hasil peramalan penggabungan Economic Constraint model dengan Technical Indicators sangat baik. Dalam tugas akhir ini dilakukan peramalan return saham pada IDX30 dengan penggabungan Economic Constraints model dan Technical Indicator, didukung dengan acuan dari penelitian sebelumnya. Berdasarkan hasil pengujian diperoleh penggabungan Economic Constraint model dengan Technical Indicators mendapatkan nilai Mean Square Error (MSE) yaitu 0.00094, dari 12 data saham yang dipakai dan 60 percobaan diperoleh bahwa terdapat 41 dari 60 percobaan menghasilkan nilai MSE lebih kecil ketika menggunakan Economic Constraint.

Kata kunci : saham, return saham, economic constraint, technical indicators, peramalan