

# **BAB I**

## **PENDAHULUAN**

### **1.1 Latar Belakang**

Pasar keuangan merupakan salah satu sektor yang sangat dinamis dan berfluktuasi. Salah satu instrumen investasi yang paling umum digunakan di pasar keuangan adalah saham. Saham merupakan bukti kepemilikan atas suatu perusahaan dan menjadi salah satu cara investor untuk berpartisipasi dalam pertumbuhan dan perkembangan perusahaan tersebut.

Dalam beberapa tahun terakhir, industri teknologi dan startup di Indonesia telah mengalami pertumbuhan yang pesat. Perusahaan-perusahaan seperti Gojek dan Tokopedia, yang sebelumnya beroperasi secara independen, memutuskan untuk bergabung menjadi satu entitas yang dikenal sebagai GOTO (Gojek Tokopedia) PT. Perusahaan ini beroperasi di berbagai sektor, termasuk ride-hailing, e-commerce, dan pembayaran digital, dan telah menjadi salah satu pemain utama dalam ekosistem teknologi Indonesia. Oleh karena itu, pergerakan harga saham GOTO PT memiliki dampak yang signifikan dalam pasar modal Indonesia [1].

Analisis harga saham merupakan salah satu metode yang digunakan untuk memprediksi pergerakan harga saham di masa depan. Salah satu metode yang dapat digunakan dalam analisis ini adalah metode ARIMA (Autoregressive Integrated Moving Average). Metode ini merupakan metode time series yang didasarkan pada asumsi bahwa data yang diamati memiliki pola tertentu yang dapat digunakan untuk memprediksi nilai di masa depan.

Metode ARIMA (Autoregressive Integrated Moving Average) cocok digunakan untuk melakukan peramalan saham karena, memiliki tingkat keakuratan peramalan yang cukup tinggi khususnya pada peramalan jangka pendek. Metode ini termasuk time series jadi saat digunakan sebagai peramalan pada saham didukung dengan data historis saham sehingga peramalan dapat dilakukan dengan baik.

Metode ini cocok digunakan untuk peramalan jangka pendek karena menggunakan data masa lalu untuk menghasilkan peramalan jangka pendek yang akurat. ARIMA sangat baik dalam ketepatan peramalan jangka pendek, sementara untuk peramalan jangka panjang, ketepatannya kurang baik [2]. Maka dari itu

penelitian ini akan melakukan peramalan harga saham GOTO.JK pada tiga hari ke depan.

Hasil penelitian ini akan memberikan manfaat bagi analis keuangan yang terlibat dalam pasar modal Indonesia. Selain itu, penelitian ini juga akan menjadi kontribusi tambahan dalam pengembangan literatur tentang analisis harga saham menggunakan metode ARIMA di konteks pasar modal Indonesia.

## **1.2 Rumusan Masalah**

Berdasarkan latar belakang yang teridentifikasi diatas, maka dapat dirumuskan beberapa rumusan masalah sebagai berikut:

1. Bagaimana mengetahui pergerakan harga saham dalam tiga hari ke depan?
2. Bagaimana membangun model ARIMA yang sesuai untuk menganalisis pergerakan harga saham?
3. Seberapa akurat model ARIMA dalam memprediksi pergerakan harga saham di masa depan?

## **1.3 Tujuan**

Terdapat beberapa tujuan yang akan dicapai dari pembuatan website, sebagai berikut :

1. Untuk mengetahui pergerakan harga saham dalam tiga hari ke depan.
2. Dapat membangun model ARIMA yang sesuai untuk menganalisis pergerakan harga saham.
3. Untuk mengetahui nilai tingkat akurasi metode ARIMA dalam memprediksi pergerakan harga saham di masa depan.

## **1.4 Batasan Masalah**

Berdasarkan pembuatan website ini terdapat beberapa Batasan masalah dalam pembuatan sebagai berikut:

1. Penelitian ini akan membatasi analisis pada data harga saham GOTO.JK, ANTM.JK, BBKA.JK, BYAN.JK, dan BBRI.JK dalam tiga hari ke depan menggunakan data historis saham harian.
2. Analisis akan memanfaatkan data harga saham yang diperoleh dari *Yahoo Finance*. Data historis ini akan digunakan untuk membangun model ARIMA.

3. Penelitian ini akan terbatas pada penerapan metode ARIMA sebagai alat analisis utama. Metode-metode analisis lainnya, seperti analisis fundamental tidak akan dibahas dalam penelitian ini.

### **1.5 Sistematika Penulisan**

Agar mempermudah pemahaman pada pembahasan penulisan skripsi ini, maka sistematika penulisan diperoleh sebagai berikut:

- BAB I : Pendahuluan berisikan latar belakang, rumusan masalah, batasan masalah, tujuan, manfaat, metode penelitian, dan sistematika penelitian.
- BAB II : Tinjauan Pustaka berisikan dasar – dasar teori mengenai permasalahan yang berhubungan dengan penelitian ini.
- BAB III : Analisis dan Perancangan pada Sistem berisikan perancangan pada sistem yang menggunakan flowchart dan desain struktur menu pada sistem
- BAB IV : Implementasi dan Pengujian berisi mengenai sistem yang akan diterapkan secara rinci dan detail mengenai konsep yang diusulkan. Serta desain sistem sesuai konsep yang diusulkan.
- BAB V : Penutup berisi kesimpulan dari hasil penelitian yang dilakukan dan saran yang dapat digunakan untuk bahan pengembangan penelitian berikutnya.

## **BAB II**

### **TINJAUAN PUSTAKA**

#### **2.1 Penelitian Terdahulu**

Menurut Rafi Almada Fatra (2022) dalam penelitiannya yang berjudul “Analisis Prediksi Harga Saham Pt Blue Bird Tbk Ditengah Pandemi Covid-19 Dengan Metode Arima Dalam Perspektif Ekonomi Islam” yang bertujuan untuk mengetahui prospek nilai saham kedepannya pada PT Blue Bird Tbk atau menganalisis prediksi harga saham blue bird di tengah pandemi covid19 menggunakan metode ARIMA mempunyai tingkat keakuratan peramalan sebesar 83.33%. Penelitian ini memberikan manfaat bagi investor berupa analisis tentang peramalan harga saham blue bird ditengah pandemi covid-19, agar dapat meminimalisir resiko dalam membeli dan menjual saham perusahaan [3].

Menurut Ahmad Fauzi (2015) dalam penelitiannya yang berjudul “Peramalan Menggunakan Model Arima Pada Harga Saham Telkom Dan Lippo” yang bertujuan menemukan pola dalam deret data historis dan mengekstrapolasikan (proses memperkirakan nilai suatu variabel melampaui interval pengamatan aslinya berdasarkan hubungan dengan variabel lain) pola tersebut ke masa depan. Peramalan dilakukan pada data in sample dan out sample. Hasil peramalan untuk 68 periode kedepan. Hasil ramalan dengan model ARIMA (0,1,1) pada data in sample dan out sample untuk saham TELKOM bernilai 2820.9 sedangkan LIPPO bernilai 1166.57, hasil ramalan bernilai flat dari hasil ramalan pertama hingga ke 68 [4].

Menurut Riana Susanti dan Askardiya Radmoyo Adji (2020) dalam penelitiannya yang berjudul “Analisis Peramalan Ihsg Dengan Time Series Modeling Arima” yang bertujuan menguji model time series Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) untuk memprediksi IHSG di Bursa Efek Indonesia. metode ARIMA dapat dipergunakan untuk meramalkan pergerakan IHSG. Model terbaik yang dipergunakan berdasarkan pengujian yang dilakukan adalah ARIMA (7,3,1). Hasil peramalan dengan model ARIMA (7,3,1) ini tidak jauh berbeda dari nilai aktual IHSG [5].