

BAB I

PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang

Telah tercatat dalam sejarah bahwa perdagangan saham sudah ada sejak abad ke-17 ketika bursa saham pertama kali didirikan di Amsterdam, Belanda. Sedangkan perdagangan saham di Indonesia dimulai pada tahun 1912 didirikan *Bataviasche Effectenhandel Vereeniging* (BEV), yang kemudian menjadi Bursa Efek Jakarta yang saat ini dikenal sebagai Bursa Efek Indonesia (BEI). Bursa ini memiliki peran penting dalam memfasilitasi perdagangan efek, serta melakukan pengawasan terhadap kegiatan perdagangan pasar modal di Indonesia. Investor akan memperhatikan Indeks Harga Saham Gabungan yang dikenal sebagai IHSG, ketika berencana berinvestasi di Bursa Efek Indonesia, investor perlu memahami pentingnya Indeks Harga Saham sebagai faktor utama dalam membuat keputusan investasi mereka. IHSG juga berperan sebagai acuan bagi investor untuk mengamati bagaimana pergerakan harga saham. (Hadinagara, 2019)[1].

Terkait dengan kondisi keuangan di masa mendatang, salah satu cara untuk mengamankannya adalah dengan memiliki investasi jangka panjang. Investasi dapat dimanfaatkan untuk memenuhi berbagai kebutuhan jangka panjang seperti persiapan pensiun, biaya pendidikan, pernikahan yang cukup tinggi di masa depan, atau sebagai alternatif untuk menghindari dampak inflasi. Investasi adalah tindakan menempatkan dana dengan harapan mendapatkan tambahan uang atau keuntungan. Pada dasarnya, investasi melibatkan penempatan sejumlah dana saat ini dengan harapan memperoleh keuntungan di masa depan. Dari pengertian ini, dapat disimpulkan bahwa investasi saham adalah alokasi sumber dana yang ada saat ini dengan harapan mendapatkan keuntungan di masa depan melalui pembelian efek berupa saham. Tujuannya adalah untuk mendapatkan tambahan atau keuntungan tertentu dari dana yang diinvestasikan dalam perdagangan saham di bursa efek. (Adnyana, 2020) [2].

Dunia bisnis saat ini berkembang dengan sangat cepat, terlihat dari banyaknya perusahaan baru yang muncul dengan keunggulan kompetitif. Hal ini menyebabkan persaingan bisnis yang sangat ketat, sehingga setiap perusahaan harus mampu mengembangkan usahanya untuk tetap bertahan dan bersaing dengan perusahaan

lain. Dalam upaya mengembangkan usahanya, perusahaan membutuhkan tambahan modal yang dapat diperoleh melalui berbagai cara, salah satunya dengan memutuskan untuk *Go Public*. Tentu tidak mudah bagi emiten untuk menarik investor agar bersedia menanamkan modalnya, karena setiap investor memiliki kriteria yang berbeda dalam menilai suatu investasi. Pada dasarnya, harga saham menjadi acuan bagi investor dalam mengambil keputusan investasi. Harga saham sering kali berfluktuasi sesuai dengan tingkat penawaran dan permintaan. Permintaan terhadap saham dipengaruhi oleh berbagai informasi yang dimiliki atau diketahui oleh investor mengenai perusahaan emiten, salah satunya adalah informasi keuangan perusahaan yang tercermin dalam laporan keuangannya. (Aprilia Puri Astuti & Erma Setiawati, 2024) [3].

Peramalan dibutuhkan karena dalam dunia nyata, seringkali kita dihadapkan dengan keputusan yang harus diambil berdasarkan situasi dan kondisi yang akan terjadi di masa depan. Oleh karena itu, teknik peramalan digunakan untuk memberikan estimasi atau perkiraan yang paling akurat dan andal sebanyak mungkin (Hernadewita et al., 2020). Dalam melakukan peramalan, terdapat beberapa metode yang dapat digunakan, seperti metode regresi, rata-rata bergerak, dan eksponensial. Masing-masing metode memiliki kelebihan dan kelemahan sendiri tergantung pada jenis data dan situasi yang dihadapi. Dalam era digital seperti sekarang, teknologi juga memberikan dampak besar pada pengembangan metode peramalan. Misalnya, teknologi Big Data memungkinkan kita untuk mengumpulkan dan menganalisis data yang lebih besar dan lebih kompleks daripada sebelumnya, sehingga dapat memberikan peramalan yang lebih akurat dan realistis (Santiari & Rahayuda, 2020).

Pergerakan harga saham memiliki peran yang signifikan bagi para pelaku pasar baik individu atau institusi keuangan dalam pengambilan keputusan. Analisis dan peramalan harga saham menjadi hal utama dalam memprediksi pergerakan harga di masa depan. Dengan memahami tren dan pola yang mungkin terjadi pada harga saham, investor dapat mengidentifikasi peluang investasi, mengelola risiko, dan mengoptimalkan keuntungan. Prediksi pasar saham adalah kumpulan data historis saham atau sekuritas yang diperdagangkan di pasar sebelumnya dan mencoba untuk memprediksi nilai masa depan saham/efek perusahaan (Wahyuni et al., 2021) [4].

Peramalan pasar saham berhubungan dengan penentuan nilai masa depan dari saham perusahaan yang diperdagangkan di bursa. Asumsi yang mendasarinya adalah semakin akurat peramalan, semakin tinggi keuntungan yang bisa didapat (Mirzaei et al., 2016) [5]. Prediksi harga saham sangat dipengaruhi oleh beragam faktor (Alkhatib et al., 2022) [6].

1.2 Rumusan Masalah

1.2.1 Permasalahan

Berdasarkan pemaparan latar belakang diatas, maka rumusan masalah dalam penelitian ini Adalah sebagai berikut:

1. bagaimana penerapan metode *Double Exponential Smoothing* dalam peramalan saham BRI?

1.2.2 Metode Usulan

Berdasarkan permasalahan yang terjadi, pada penelitian ini dilakukan Metode usulan yang digunakan yaitu implementasi menggunakan *metode Double Exponential Smoothing* dengan melakukan pengujian data saham BRI pada Januari-Desember 2024..

1.2.3 Pertanyaan

Pertanyaan pada penelitian ini yaitu bagaimana nilai akurasi atau nilai MAPE dan nilai di tahun berikutnya menggunakan metode Double Exponential Smoothing menggunakan excel pada implementasi data saham BRI?

1.3 Tujuan dan Manfaat

1.3.1 Tujuan

Tujuan yang ingin dicapai oleh penulis dari penelitian Implementasi Metode *Double exponential smoothing* pada peramalan saham BRI adalah sebagai berikut:

1. Mengetahui penerapan metode *double exponential smoothing* dalam peramalan saham BRI.
2. Mengetahui nilai MAPE dan peramalan pada tahun berikutnya.

1.3.2 Manfaat

1. Dengan adanya penelitian ini dapat menambah wawasan mengenai metode SVM.
2. Sebagai bahan referensi bagi penelitian selanjutnya.

3. Dengan menggunakan Metode Double Exponential Smoothing dapat melakukan implementasi terhadap data saham BRI.

1.4 Batasan Masalah

Penerapan metode *Double Exponential Smoothing* dalam peramalan saham Bank BRI memiliki batasan masalah sebagai berikut:

1. Data yang digunakan bersumber dari Bank BRI.
2. Tidak menggunakan aplikasi melainkan menggunakan perhitungan dan grafik pada excel.
1. Kriteria yang digunakan sebagai parameter adalah data pada bulan Januari-Desember 2024.

1.5 Sistematika Penulisan

Sistematika penulisan penelitian ini dibagi dalam 5 bab yaitu:

1. BAB I PENDAHULUAN

Bab ini merupakan bagian awal yang berisi mengenai penjelasan latar belakang masalah, Perumusan masalah, tujuan penelitian, manfaat penelitian, batasan masalah dan sistematika proposal.

2. BAB II KAJIAN PUSTAKA

Pada bab ini membahas mengenai teori-teori yang digunakan untuk menyelesaikan penelitian ini dan kajian penelitian terdahulu yang mengimplementasikan metode Double Exponential Smoothing.

3. BAB III METODOLOGI PENELITIAN

Pada bab ini membahas tentang kebutuhan sistem, tahapan penelitian, dan Double Exponential Smoothing untuk peramalan.

4. BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

Bab ini memuat mengenai implementasi yang sesuai dengan rancangan yang telah dibuat pada bab sebelumnya yang berisi tahap *preprocessing* data, hasil akurasi MAPE dengan metode Double Exponential smoothing, juga terdapat hasil dari uji peramalan di tahun berikutnya.

5. BAB V PENUTUP

Pada bab ini berisi tentang kesimpulan penelitian dan saran bagi penelitian selanjutnya.