

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Dari penelitian ini didapatkan kesimpulan sebagai berikut.

1. Indeks Harga Saham Gabungan mengalami tren yang cukup stabil pada periode 28 Maret 2022 hingga 27 Maret 2023. Indeks Harga Saham Gabungan mencapai angka tertinggi pada bulan September 2022 dan cenderung terus mengalami penurunan hingga bulan Maret 2023. Selama kurun waktu tanggal 28 Maret 2022 hingga 27 Maret 2023, Indeks Harga Saham Gabungan paling rendah terjadi pada 16 Maret 2023 yaitu sebesar 6.565,73. Sementara itu Indeks Harga Saham Gabungan paling tinggi terjadi pada tanggal 13 September 2022 yaitu sebesar 7.318,02. Pada 28 Maret 2022 hingga 27 Maret 2023, rata-rata Indeks Harga Saham Gabungan berkisar di angka 6.960,1883 dengan standart deviasi sebesar 178,21708 yang menunjukkan fluktuasi harian dari Indeks Harga Saham Gabungan.
2. Model Indeks Harga Saham Gabungan terbaik adalah model regresi nonparametrik polinomial lokal derajat 1 (linear lokal), dengan nilai bandwidth sebesar 4 dan titik lokal (x_0) sebesar 6972,45 yang menghasilkan GCV sebesar $1,46 \times 10^{-23}$ dan MSE sebesar $7,085 \times 10^{-23}$. Adapun model Indeks Harga Saham Gabungan menggunakan Regresi Nonparametrik Polinomial Lokal Derajat 1 adalah sebagai berikut.

$$\hat{y}_t = 6973,45 + 1(y_{t-1} - 6972,45)$$

3. Pada evaluasi kinerja model Indeks Harga Saham Gabungan menggunakan regresi nonparametrik polinomial lokal derajat 1 menggunakan MAPE *out sample* yang dihitung berdasarkan data actual *out sample*. Berdasarkan perhitungan didapatkan nilai MAPE sebesar 0,69%. Hal ini berarti bahwa model Indeks Harga Saham Gabungan menggunakan regresi nonparametrik polinomial lokal derajat 1 memiliki kemampuan peramalan yang sangat baik.

5.2 Saran

Saran bagi penelitian berikutnya dapat digunakan data pengamatan dengan tahun terbaru dan bisa menggunakan banyak data predictor sehingga dapat memberikan informasi yang lebih kepada para investor. Untuk peneliti penulis selanjutnya dapat mencari estimasi model regresi nonparametrik polynomial dengan menggunakan estimator lain, misalnya estimator sepline atau penalized Seplin dengan lebih banyak variabel prediktor dan dengan menggunakan distributor eror yang lain.

