

**PENGARUH HARGA *OPEN*, *HIGH*, DAN *LOW*  
TERHADAP HARGA *CLOSE* SERTA PERAMALAN  
HARGA *CLOSE* SAHAM BBCA MENGGUNAKAN  
PENGUJIAN HIPOTESIS DAN METODE REGRESI  
LINIER**

**SKRIPSI**

Oleh:

**AHMAD WAHYUDIN**

**201910215156**



**PROGRAM STUDI TEKNIK INDUSTRI  
FAKULTAS TEKNIK  
UNIVERSITAS BHAYANGKARA JAKARTA RAYA  
2023**

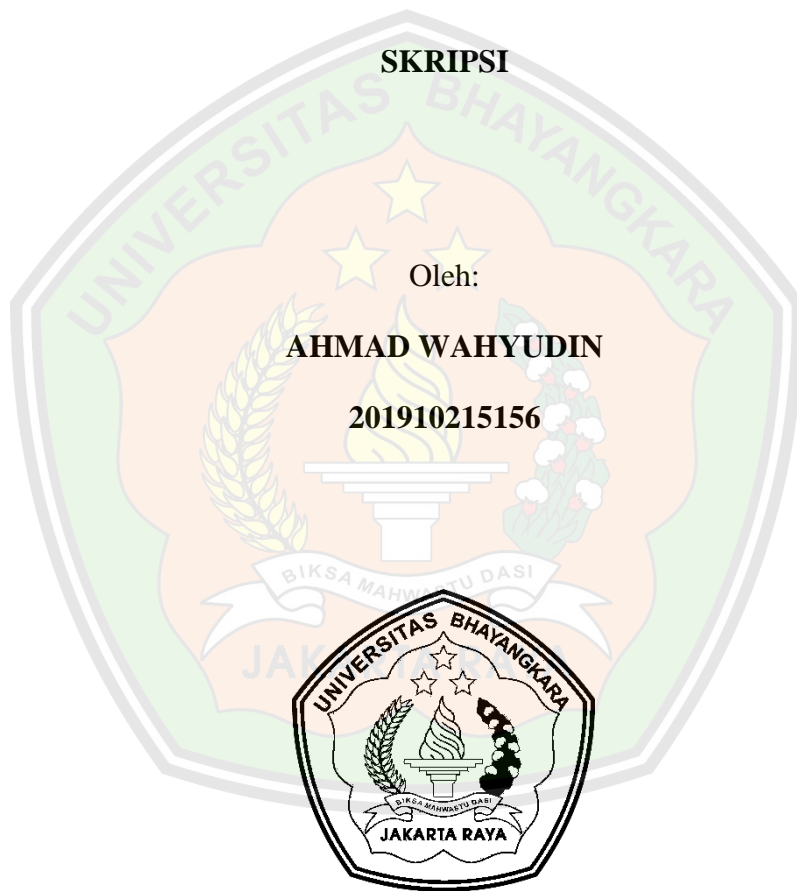
**PENGARUH HARGA *OPEN*, *HIGH*, DAN *LOW*  
TERHADAP HARGA *CLOSE* SERTA PERAMALAN  
HARGA *CLOSE* SAHAM BBCA MENGGUNAKAN  
PENGUJIAN HIPOTESIS DAN METODE REGRESI  
LINIER**

**SKRIPSI**

Oleh:

**AHMAD WAHYUDIN**

**201910215156**



**PROGRAM STUDI TEKNIK INDUSTRI  
FAKULTAS TEKNIK  
UNIVERSITAS BHAYANGKARA JAKARTA RAYA  
2023**

## LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING

Judul Skripsi : Pengaruh Harga *Open*, *High*, dan *Low* Terhadap  
Harga *Close* serta Peramalan Harga *Close*  
Saham BBCA Menggunakan Pengujian  
Hipotesis dan Metode Regresi Linier

Nama Mahasiswa : Ahmad Wahyudin

Nomor Pokok Mahasiswa : 201910215156

Program Studi/Fakultas : Teknik Industri/Teknik


Tanggal Lulus Ujian Skripsi : 17 Juli 2023


Bekasi, 27 Juli 2023

MENYETUJUI,

Pembimbing I

Pembimbing II

  
Iskandar Zulkarnaen, S.T., M.T.  
NIDN 0312128203

  
Alloysius Vendhi Prasmoro, S.T., M.T.  
NIDN 0317117905

## LEMBAR PENGESAHAN

Judul Skripsi : Pengaruh Harga *Open*, *High*, dan *Low* Terhadap  
Harga *Close* serta Peramalan Harga *Close*  
Saham BBCA Menggunakan Pengujian  
Hipotesis dan Metode Regresi Linier

Nama Mahasiswa : Ahmad Wahyudin

Nomor Pokok Mahasiswa : 201910215156

Program Studi/Fakultas : Teknik Industri/Teknik

Tanggal Lulus Ujian Skripsi : 17 Juli 2023

Bekasi, 27 Juli 2023

MENGESAHKAN,

Ketua Tim Penguji : Ir. Achmad Muhazir, M.T.  
NIDN 0316037002

Penguji I : Murwan Widvantoro, S.Pd., M.T.  
NIDN 0301048601

Penguji II : Iskandar Zulkarnaen, S.T., M.T.  
NIDN 0312128203



MENGETAHUI,

Ketua Program Studi  
Teknik Industri



Ir. Zulkani Sinaga, M.T.  
NIDN 0331016905

Dekan  
Fakultas Teknik



Dr. Tulus Sukreni, S.T., M.T.  
NIDN 0324047505

## LEMBAR PERNYATAAN

Dengan ini saya menyatakan bahwa:

Skripsi yang berjudul “Pengaruh Harga *Open*, *High*, dan *Low* Terhadap Harga *Close* serta Peramalan Harga *Close* Saham BBKA Menggunakan Pengujian Hipotesis dan Metode Regresi Linier” ini adalah benar-benar merupakan hasil karya sendiri dan tidak mengandung materi yang ditulis oleh orang lain kecuali pengutipan sebagai referensi yang sumbernya telah dituliskan secara jelas sesuai dengan kaidah penulisan karya ilmiah.

Apabila di kemudian hari ditemukan adanya kecurangan dalam karya ini, saya bersedia menerima sanksi dari Universitas Bhayangkara Jakarta Raya sesuai dengan peraturan yang berlaku.

Saya mengizinkan skripsi ini dipinjam dan digandakan melalui Perpustakaan Universitas Bhayangkara Jakarta Raya.

Saya memberikan izin kepada Perpustakaan Universitas Bhayangkara Jakarta Raya untuk menyimpan skripsi ini dalam bentuk digital dan mempublikasikannya melalui internet selama publikasi tersebut melalui portal Universitas Bhayangkara Jakarta Raya.

Bekasi, 18 Juni 2023

Yang membuat pernyataan



Ahmad Wahyudin

201910215156

## ABSTRAK

**AHMAD WAHYUDIN. 201910215156.** Pengaruh Harga *Open*, *High*, dan *Low* Terhadap Harga *Close* serta Peramalan Harga *Close* Saham BBCA Menggunakan Pengujian Hipotesis dan Metode Regresi Linier.

Saham adalah salah satu alat investasi di pasar modal berupa surat berharga perusahaan yang dijadikan sebagai alat kepemilikan oleh seseorang atau instansi. Ada banyak perusahaan yang menjual sahamnya kepada masyarakat di pasar modal. Namun, pada penelitian ini difokuskan hanya pada saham BBCA. Pergerakan harga saham BBCA mengalami fluktuatif, hal tersebut terjadi karena dipengaruhi oleh beberapa variabel sehingga menyebabkan investor kesulitan dalam meramalkan harga saham. Tujuan dari penelitian ini yaitu untuk mengetahui pengaruh harga *open*, *high*, dan *low* terhadap harga *close* serta peramalan harga *close* saham BBCA. Penelitian ini dilakukan dengan pengujian hipotesis dan metode regresi linier. Hasil penelitian ini menjelaskan bahwa harga *open*, *high*, dan *low* berpengaruh terhadap harga *close* serta peramalan harga *close* saham untuk hari selanjutnya sebesar Rp. 8.617. Peramalan harga *close* saham BBCA menggunakan metode regresi linier mendapatkan nilai RMSE 0,045 sehingga dapat dinyatakan memiliki kesalahan yang kecil dan memberikan hasil yang baik dalam meramalkan harga *close* saham BBCA.

Kata Kunci: saham, pengujian hipotesis, peramalan, regresi linier.

## **ABSTRACT**

**AHMAD WAHYUDIN. 201910215156.** *Price Influence Open, High, and Low Against Price Close and Price Forecasting Close BBCA Stock Using Hypothesis Testing and Linear Regression Method.*

*Stocks are one of the investment tools in the capital market in the form of company securities which are used as a means of ownership by a person or institution. There are many companies that sell their shares to the public in the capital market. However, this research is focused only on BBCA shares. The movement of BBCA's share price has fluctuated, this occurs because it is influenced by several variables, causing investors to have difficulty predicting share prices. The purpose of this study is to determine the effect of price open, high, and low against price close as well as price forecasting close BBCA shares. This research was conducted by testing the hypothesis and linear regression method. The results of this study explain that the price open, high, and low effect on prices close as well as price forecasting close shares for the next day of Rp. 8,617. Price forecasting close BBCA shares using the linear regression method get an RMSE value of 0.045 so that it can be stated to have a small error and provide good results in forecasting prices close BBCA shares.*

*Keywords: stocks, hypothesis testing, forecasting, linear regression.*

**LEMBAR PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI  
KARYA ILMIAH UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS**

---

Sebagai civitas akademik Universitas Bhayangkara Jakarta Raya, Saya bertanda tangan di bawah ini:

Nama : Ahmad Wahyudin  
Nomor Pokok Mahasiswa : 201910215156  
Program Studi : Teknik Industri  
Jenis Karya : Skripsi / Tesis / Karya-Ilmiah

Demi pengembangn ilmu pengetahuan, saya menyetujui untuk memberikan kepada Universitas Bhayangkara Jakarta Raya Hak bebas Non-Eksklusif (*Non Exclusive Royalty-Free Right*), atas skripsi yang berjudul:

**PENGARUH HARGA *OPEN*, *HIGH*, DAN *LOW* TERHADAP HARGA  
*CLOSE* SERTA PERAMALAN HARGA *CLOSE* SAHAM BBKA  
MENGUNAKAN PENGUJIAN HIPOTESIS DAN METODE REGRESI  
LINIER**

Beserta perangkat yang ada (bila diperlukan) dengan hak yang bebas royalti non-eksklusif ini. Universitas Bhayangkara Jakarta Raya berhak menyimpan, mengalih media/formatkan, mengelolanya dalam bentuk pangkalan data (*database*), mendistribusikan dan menampilkan publikasinya di internet atau media lain untuk kepentingan akademis tanpa perlu permintaan izin dari saya sebaga pemilik hak cipta. Segala bentuk tuntutan hukum yang timbul atas pelanggaran hak cipta dalam skripsi ini menjadi tanggung jawab saya pribadi.

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Dibuat di : BEKASI  
Pada Tanggal : 18 Juni 2023  
Yang menyatakan,



Ahmad Wahyudin



## KATA PENGANTAR

Segala puji bagi Allah SWT atas rahmat dan hidayah-Nya karena telah memberikan kesihatan sehingga membuat penulis dapat berpikir dengan baik untuk menyelesaikan skripsi dengan judul “Pengaruh Harga *Open*, *High*, dan *Low* Terhadap Harga *Close* serta Peramalan Harga *Close* Saham BBCA Menggunakan Pengujian Hipotesis dan Metode Regresi Linier”.

Skripsi ini diselesaikan dengan tujuan memenuhi salah satu persyaratan mata kuliah skripsi agar mendapatkan gelar Strata 1 (S-1) di Program Studi Teknik Industri Universitas Bhayangkara Jakarta Raya. Dalam menyelesaikan skripsi ini, penulis mengucapkan terimakasih kepada:

1. Bapak Saim dan Ibu Titik Sumarni selaku orang tua yang telah memberikan semangat, doa, dan dukungan agar dapat menyelesaikan skripsi ini.
2. Bapak Iskandar Zulkarnaen, S.T., M.T. Sebagai Dosen Pembimbing pertama yang telah memberikan saran kepada penulis.
3. Bapak Alloysius Vendhi Prasmoro, S.T., M.T. Sebagai Dosen Pembimbing Kedua yang telah memberikan saran kepada penulis.
4. Bapak Irjen Pol (Purn) Dr. Drs. Bambang Karsono, SII., MM. Selaku Rektor Universitas Bhayangkara Jakarta Raya.
5. Ibu Dr. Tulus Sukreni, S.T., M.T. Selaku Dekan Fakultas Teknik Universitas Bhayangkara Jakarta Raya.
6. Bapak Ir. Zulkani Sinaga, M.T. Sebagai Ketua Program Studi Teknik Industri.
7. Para Dosen dan Staf Fakultas Teknik Universitas Bhayangkara Jakarta Raya yang telah memberikan ilmu pengetahuan dan informasi yang bermanfaat selama mengikuti perkuliahan.
8. Teman-teman yang sesama menggali ilmu di universitas Bhayangkara karena telah memberikan semangat, pengetahuan, dan pengalaman bagi penulis selama mengikuti perkuliahan dan menyelesaikan skripsi.

Semoga segala yang diperoleh penulis dapat dibalas dengan pahala yang berlipat ganda oleh Allah SWT.

Penulis mempunyai keterbatasan akan kemampuan dalam penulisan, bahasa yang digunakan, penyajian materi, ilmu pengetahuan, dan pengalaman yang dimiliki serta yakin skripsi ini membutuhkan masukan dan saran dari semua yang membaca skripsi ini supaya nantinya dapat memberikan ilmu pengetahuan dan penelitian yang lebih baik lagi.

Penulis berharap dengan adanya skripsi ini bisa menambah ilmu pengetahuan kepada pembaca, terutama untuk mahasiswa dan mahasiswi Universitas Bhayangkara Jakarta Raya.

Bekasi, 18 Juni 2023



Ahmad Wahyudin



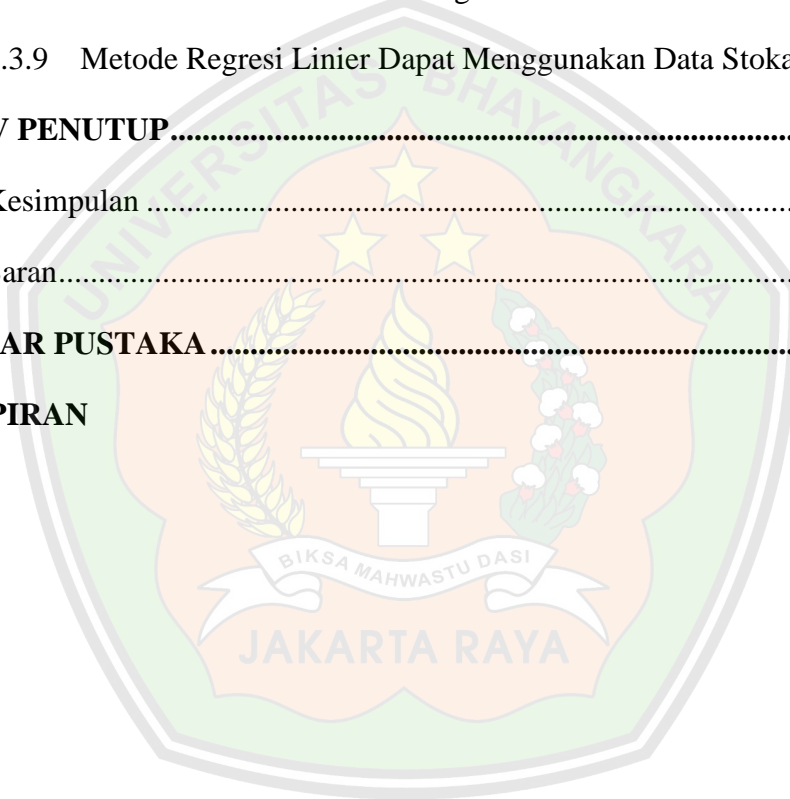
# DAFTAR ISI

	Halaman
<b>LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING .....</b>	<b>ii</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN .....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>v</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>vi</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS .....</b>	<b>vii</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xv</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xvi</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	6
1.3 Rumusan Masalah .....	6
1.4 Batasan Masalah.....	7
1.5 Tujuan Penelitian .....	7
1.6 Manfaat Penelitian .....	7
1.7 Tempat dan Waktu Penelitian .....	8
1.8 Sistematika Penulisan .....	8
<b>BAB II LANDASAN TEORI .....</b>	<b>10</b>
2.1 Investasi.....	10

2.2	Pasar Modal.....	11
2.3	Saham.....	12
2.3.1	Keuntungan Berinvestasi Saham.....	13
2.3.2	Kerugian Berinvestasi Saham.....	14
2.4	Hipotesis.....	15
2.4.1	Pengaruh Harga <i>Open</i> terhadap Harga <i>Close</i> .....	15
2.4.2	Pengaruh Harga <i>High</i> terhadap Harga <i>Close</i> .....	15
2.4.3	Pengaruh Harga <i>Low</i> terhadap Harga <i>Close</i> .....	16
2.5	Peramalan.....	16
2.6	Regresi Linier.....	17
2.6.1	Menguji <i>Performance</i> Dari Metode Regresi.....	19
2.7	<i>Robot Trading</i> .....	20
2.8	SmartPLS .....	21
2.9	RapidMiner .....	21
2.10	Penelitian Terdahulu .....	21
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....</b>		<b>25</b>
3.1	Jenis Penelitian.....	25
3.2	Jenis dan Sumber Data.....	25
3.3	Populasi dan Sampel .....	25
3.4	Teknik Pengumpulan Data.....	26
3.5	Teknik Pengolahan Data .....	26
3.5.1	<i>Outer Model</i> .....	26
3.5.2	<i>Inner Model</i> .....	28
3.5.3	Pengujian Hipotesis.....	29
3.5.4	Pengujian Model .....	29

3.5.5	Pengujian <i>Performance</i> .....	29
3.6	Kerangka Berpikir .....	29
3.7	Metode Penelitian.....	32
<b>BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>33</b>
4.1	Gambaran Perusahaan .....	33
4.2	Analisis Data .....	34
4.2.1	Hasil Pengujian <i>Outer Model</i> .....	34
4.2.1.1	<i>Convergent Validity</i> .....	35
4.2.1.2	<i>Discriminant Validity</i> .....	36
4.2.1.3	<i>Average Variance Extracted (AVE)</i> .....	36
4.2.1.4	<i>Composite Reliability</i> .....	37
4.2.1.5	<i>Cronbach's Alpha</i> .....	38
4.2.2	Hasil Pengujian <i>Inner Model</i> .....	38
4.2.2.1	<i>R-Square (R<sup>2</sup>)</i> .....	39
4.2.2.2	<i>Q-Square (Q<sup>2</sup>)</i> .....	40
4.2.2.3	<i>F-Square</i> .....	40
4.2.3	Hasil Pengujian Hipotesis .....	41
4.2.4	Desain Model .....	42
4.2.4.1	Pengujian Model .....	43
4.2.4.2	Pengujian <i>Performance</i> .....	45
4.3	Pembahasan Hasil Analisis Data.....	46
4.3.1	Pengaruh Harga <i>Open</i> Terhadap Harga <i>Close</i> Dalam Meramalkan Harga <i>Close</i> Saham BBCA .....	46
4.3.2	Pengaruh Harga <i>High</i> Terhadap Harga <i>Close</i> Dalam Meramalkan Harga <i>Close</i> Saham BBCA .....	46

4.3.3	Pengaruh Harga <i>Low</i> Terhadap Harga <i>Close</i> Dalam Meramalkan Harga <i>Close</i> Saham BBCA .....	47
4.3.4	Pengaruh Harga <i>Open</i> , <i>High</i> , dan <i>Low</i> Terhadap Harga <i>Close</i> Dalam Meramalkan Harga <i>Close</i> Saham BBCA.....	48
4.3.5	Pengujian Model .....	48
4.3.6	Pengujian <i>Performance</i> .....	48
4.3.7	Pembahasan.....	49
4.3.8	Perbedaan Penelitian Ini Dengan Penelitian Terdahulu.....	49
4.3.9	Metode Regresi Linier Dapat Menggunakan Data Stokastik.....	50
<b>BAB V PENUTUP.....</b>		<b>51</b>
5.1	Kesimpulan .....	51
5.2	Saran.....	51
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>52</b>
<b>LAMPIRAN</b>		



## DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1. Penelitian Terdahulu Yang Berkaitan Dengan Penelitian ini .....	22
Tabel 4.1. Nilai <i>Outer Loading</i> .....	35
Tabel 4.2. Nilai <i>Cross Loading</i> .....	36
Tabel 4.3. Nilai <i>Average Variance Extracted (AVE)</i> .....	37
Tabel 4.4. Nilai <i>Composite Reliability</i> .....	37
Tabel 4.5. Nilai <i>Cronbach's Alpha</i> .....	38
Tabel 4.6. Nilai <i>R-Square</i> .....	39
Tabel 4.7. Nilai <i>F-Square</i> .....	40
Tabel 4.8. Hasil Pengujian Hipotesis .....	41
Tabel 4.9. Hasil Pengujian Model .....	43
Tabel 4.10. Hasil Pengujian Model .....	44
Tabel 4.11. Hasil Pengujian <i>Performance</i> .....	45

## DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1.1. Jumlah dan Pertumbuhan Investor Pasar Modal .....	2
Gambar 1.2. Pergerakan Harga Saham BBKA .....	3
Gambar 3.1. Kerangka Berpikir .....	31
Gambar 4.1. Desain Model SmartPLS .....	34
Gambar 4.2. Hasil <i>Outer Model</i> .....	35
Gambar 4.3. Hasil <i>Inner Model</i> .....	39
Gambar 4.4. Desain Model RapidMiner .....	43





## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Harga Saham BBCA

Lampiran 2. Plagiarisme

Lampiran 3. Biodata Mahasiswa

Lampiran 4. Kartu Bimbingan Mahasiswa

