

ABSTRAK

Pergerakan harga saham pada dasarnya tidak dapat diprediksi dengan pasti, tetapi pergerakan tersebut dapat diperkirakan. Untuk memperkirakan pergerakan harga saham, maka akan dibuat suatu model matematika yang memanfaatkan pembangkitan bilangan random sebagai sampel data harga sahamnya. Melalui model matematika tersebut dapat diperoleh suatu simulasi pergerakan harga saham.

Suatu data harga saham yang akan diprediksi pergerakannya harus diuji terlebih dahulu normalitas returnnya. Hal ini dikarenakan model matematika dan simulasi pergerakan harga saham tersebut akan berlaku untuk data harga saham yang mempunyai return yang berdistribusi normal. Dengan menggunakan rata-rata dan simpangan baku data harga saham yang sesungguhnya dan komputasi asset path, maka akan didapatkan suatu perkiraan pergerakan harga saham.

ABSTRACT

It is basically impossible to define the movement of asset price, but it is possible to make some predictions. A mathematical model is designed in order to estimate the movement of asset price. This model uses random numbers as the sample of the asset price and can be used as a simulation model of the movement of asset price.

The distribution of the estimated asset price return should be tested whether it is normally distributed or not. The reason is, the fact that the mathematical model and asset price simulation will only be work for asset price that the return has normally distributed. The estimation of asset price movement can be estimate by counting the mean and standard deviation of the real asset price and the computation of asset path.