

DAFTAR ISI

halaman

HALAMAN JUDUL	
PERNYATAAN DAN PERSETUJUAN UNGGAH TUGAS AKHIR	
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING	
PERSETUJUAN TIM PENGUJI SKRIPSI	
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	2
1.3 Tujuan Penelitian	2
1.4 Batasan dan Asumsi	3
1.5 Manfaat Penelitian	3
1.5.1 Manfaat Teoritis	4
1.5.2 Manfaat Praktis	4
1.6 Struktur Penulisan	4
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Pasar Modal	6
2.1.1 Harga Saham	6
2.1.2 Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	6
2.2 Volatilitas Harga Saham	7
2.3 Model Regresi Linear	8
2.4 <i>Generalized Linear Models</i>	8
2.4.1 Regresi Gamma	9
2.5 Kajian Pustaka	10
BAB III METODOLOGI	
3.1 Data	12
3.1.1 Data Jumlah Penjualan Album Fisik	12
3.1.2 Data Jumlah Penjualan Album Digital	12
3.1.3 Data Faktor-faktor Eksternal Lain	12
3.2 Variabel Independen	13
3.3 Variabel Dependen	13
3.4 Pembersihan Data dan Pengisian Data Kosong	14
3.5 Pembuatan Model dan Prediksi Harga Saham	14
3.6 Mengevaluasi Model	15
3.7 Analisis Galat Model	15

3.7.1	<i>Mean Squared Error (MSE)</i>	16
3.7.2	<i>Root Mean Square Error (RMSE)</i>	16
3.7.3	<i>Mean Absolute Error (MAE)</i>	16
3.7.4	<i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i>	16
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN		
4.1	Hasil dan Analisis Regresi Gamma dan Regresi Linear	18
4.1.1	SM Entertainment	19
4.1.2	JYP Entertainment	24
4.1.3	YG Entertainment	29
4.2	Menghitung Nilai Galat dan Analisanya	33
4.2.1	Analisis Galat Model SM Entertainment	34
4.2.1.1	<i>Mean Squared Error (MSE)</i>	35
4.2.1.2	<i>Root Mean Square Error (RMSE)</i>	36
4.2.1.3	<i>Mean Absolute Error (MAE)</i>	37
4.2.1.4	<i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i>	38
4.2.2	Analisis Galat Model JYP Entertainment	39
4.2.2.1	<i>Mean Squared Error (MSE)</i>	40
4.2.2.2	<i>Root Mean Square Error (RMSE)</i>	41
4.2.2.3	<i>Mean Absolute Error (MAE)</i>	43
4.2.2.4	<i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i>	45
4.2.3	Analisis Galat Model YG Entertainment	46
4.2.3.1	<i>Mean Squared Error (MSE)</i>	46
4.2.3.2	<i>Root Mean Square Error (RMSE)</i>	48
4.2.3.3	<i>Mean Absolute Error (MAE)</i>	49
4.2.3.4	<i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i>	51
4.3	Pemilihan Model Akhir	52
4.3.1	Pemilihan Model Akhir untuk Perusahaan SM Entertainment	53
4.3.2	Pemilihan Model Akhir untuk Perusahaan JYP Entertainment	54
4.3.3	Pemilihan Model Akhir untuk Perusahaan YG Entertainment	56
BAB V PENUTUP		
5.1	Kesimpulan	59
5.2	Saran	59
DAFTAR PUSTAKA		
LAMPIRAN		

DAFTAR GAMBAR

	halaman
Gambar 3.1 <i>Flowchart</i> Penelitian	11
Gambar 4.1 Histogram Variabel Dependen untuk Ketiga Perusahaan . .	34
Gambar 4.2 Hasil Regresi Model 3 Menggunakan Data 2012-2020 untuk Persamaan Harga Saham JYP	56
Gambar 4.3 Hasil Regresi Model 3 Menggunakan Data 2012-2020 untuk Persamaan Harga Saham YG	58



DAFTAR TABEL

	halaman
Tabel 4.1 Hasil Regresi SM Entertainment: Kondisi Pertama	19
Tabel 4.2 Nilai AIC Model SM: Kondisi Pertama	19
Tabel 4.3 Hasil Regresi SM Entertainment: Kondisi Kedua	19
Tabel 4.4 Nilai AIC Model SM: Kondisi Kedua	20
Tabel 4.5 Hasil Regresi SM Entertainment: Kondisi Ketiga	20
Tabel 4.6 Nilai AIC Model SM: Kondisi Ketiga	20
Tabel 4.7 Hasil Regresi SM Entertainment: Kondisi Keempat	21
Tabel 4.8 Nilai AIC Model SM: Kondisi Keempat	21
Tabel 4.9 Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai AIC untuk Harga Saham	21
Tabel 4.10 Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai AIC untuk Volatilitas Harga Saham	22
Tabel 4.11 Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai AIC untuk Pengembalian Harga Saham	23
Tabel 4.12 Hasil Regresi JYP Entertainment: Kondisi Pertama	24
Tabel 4.13 Nilai AIC Model JYP: Kondisi Pertama	24
Tabel 4.14 Hasil Regresi JYP Entertainment: Kondisi Kedua	24
Tabel 4.15 Nilai AIC Model JYP: Kondisi Kedua	25
Tabel 4.16 Hasil Regresi JYP Entertainment: Kondisi Ketiga	25
Tabel 4.17 Nilai AIC Model JYP: Kondisi Ketiga	26
Tabel 4.18 Hasil Regresi JYP Entertainment: Kondisi Keempat	26
Tabel 4.19 Nilai AIC Model JYP: Kondisi Keempat	26
Tabel 4.20 Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai AIC untuk Harga Saham	27
Tabel 4.21 Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai AIC untuk Volatilitas Harga Saham	27
Tabel 4.22 Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai AIC untuk Pengembalian Harga Saham	28
Tabel 4.23 Hasil Regresi YG Entertainment: Kondisi Pertama	29
Tabel 4.24 Nilai AIC Model YG: Kondisi Pertama	29
Tabel 4.25 Hasil Regresi YG Entertainment: Kondisi Kedua	30
Tabel 4.26 Nilai AIC Model YG: Kondisi Kedua	30
Tabel 4.27 Hasil Regresi YG Entertainment: Kondisi Ketiga	30
Tabel 4.28 Nilai AIC Model YG: Kondisi Ketiga	31
Tabel 4.29 Hasil Regresi YG Entertainment: Kondisi Keempat	31
Tabel 4.30 Nilai AIC Model YG: Kondisi Keempat	31
Tabel 4.31 Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai AIC untuk Harga Saham	32
Tabel 4.32 Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai AIC untuk Volatilitas Harga Saham	32
Tabel 4.33 Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai AIC untuk Pengembalian Harga Saham	32

Tabel 4.34	Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai MSE untuk Setiap Kondisi	35
Tabel 4.35	Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai RMSE untuk Setiap Kondisi	36
Tabel 4.36	Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai MAE untuk Setiap Kondisi	37
Tabel 4.37	Rangkuman Model SM Berdasarkan Nilai MAPE untuk Setiap Kondisi	38
Tabel 4.38	Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai MSE untuk Setiap Kondisi	40
Tabel 4.39	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai MSE untuk Persamaan Harga Saham JYP	40
Tabel 4.40	Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai RMSE untuk Setiap Kondisi	42
Tabel 4.41	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai RMSE untuk Persamaan Harga Saham JYP	42
Tabel 4.42	Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai MAE untuk Setiap Kondisi	43
Tabel 4.43	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai MAE untuk Persamaan Harga Saham JYP	44
Tabel 4.44	Rangkuman Model JYP Berdasarkan Nilai MAPE untuk Setiap Kondisi	45
Tabel 4.45	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai MAPE untuk Persamaan Harga Saham JYP	45
Tabel 4.46	Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai MSE untuk Setiap Kondisi	47
Tabel 4.47	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai MSE untuk Persamaan Harga Saham YG	47
Tabel 4.48	Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai RMSE untuk Setiap Kondisi	48
Tabel 4.49	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai RMSE untuk Persamaan Harga Saham YG	49
Tabel 4.50	Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai MAE untuk Setiap Kondisi	50
Tabel 4.51	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai MAE untuk Persamaan Harga Saham YG	50
Tabel 4.52	Rangkuman Model YG Berdasarkan Nilai MAPE untuk Setiap Kondisi	51
Tabel 4.53	Proses Pemilihan Model Berdasarkan Nilai MAPE untuk Persamaan Harga Saham YG	52
Tabel 4.54	Rangkuman Model Terpilih: SM Entertainment	53
Tabel 4.55	Perbandingan Jurnal Acuan dan Penelitian Ini	54
Tabel 4.56	Rangkuman Model Terpilih: JYP Entertainment	55

Tabel 4.57 Rangkuman Model Terpilih: JYP Entertainment (Sebelum Pemeriksaan)	55
Tabel 4.58 Rangkuman Model Terpilih: YG Entertainment	57
Tabel 4.59 Rangkuman Model Terpilih: YG Entertainment (Sebelum Pemeriksaan)	57



DAFTAR LAMPIRAN

	halaman
Lampiran A Data	
A.1 Data Perusahaan SM Entertainment	A-1
A.2 Data Perusahaan JYP Entertainment	A-10
A.3 Data Perusahaan YG Entertainment	A-19
Lampiran B Hasil Regresi SM Entertainment	
B.1 SM Entertainment: Kondisi Pertama	B-1
B.2 SM Entertainment: Kondisi Kedua	B-5
B.3 SM Entertainment: Kondisi Ketiga	B-10
B.4 SM Entertainment: Kondisi Keempat	B-14
Lampiran C Hasil Regresi JYP Entertainment	
C.1 JYP Entertainment: Kondisi Pertama	C-1
C.2 JYP Entertainment: Kondisi Kedua	C-5
C.3 JYP Entertainment: Kondisi Ketiga	C-9
C.4 JYP Entertainment: Kondisi Keempat	C-12
Lampiran D Hasil Regresi YG Entertainment	
D.1 YG Entertainment: Kondisi Pertama	D-1
D.2 YG Entertainment: Kondisi Kedua	D-5
D.3 YG Entertainment: Kondisi Ketiga	D-10
D.4 YG Entertainment: Kondisi Keempat	D-14

