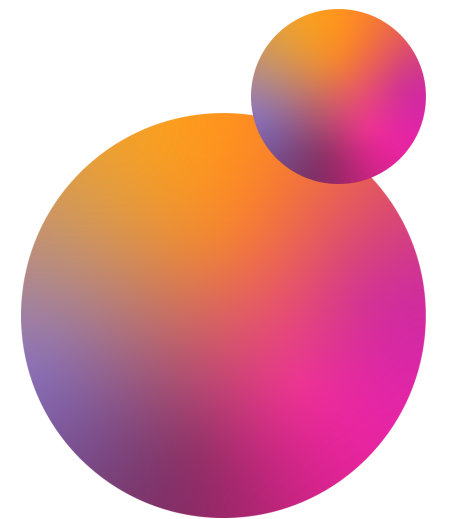


Analisa Regresi Performa Saham : Study Case Perusahaan Kelapa Sawit

Omar Charis Atthabrizi
Novta Winkey Pradana
Andri Erlianto Sandi
Dody Permadi

Bussiness Understanding

Perusahaan sekuritas menyediakan beragam jasa dan layanan kepada klien mereka yang terkait dengan perdagangan saham, valuta asing, obligasi, dan beragam instrumen keuangan lainnya. Perusahaan sekuritas mendapatkan keuntungan materil dari transaksi keuangan tersebut yang berupa **komisi** maupun **selisih harga jual/beli**, dan keuntungan non materil yang berupa **kepuasan** dan **kepercayaan pelanggan**.



Problem Identification

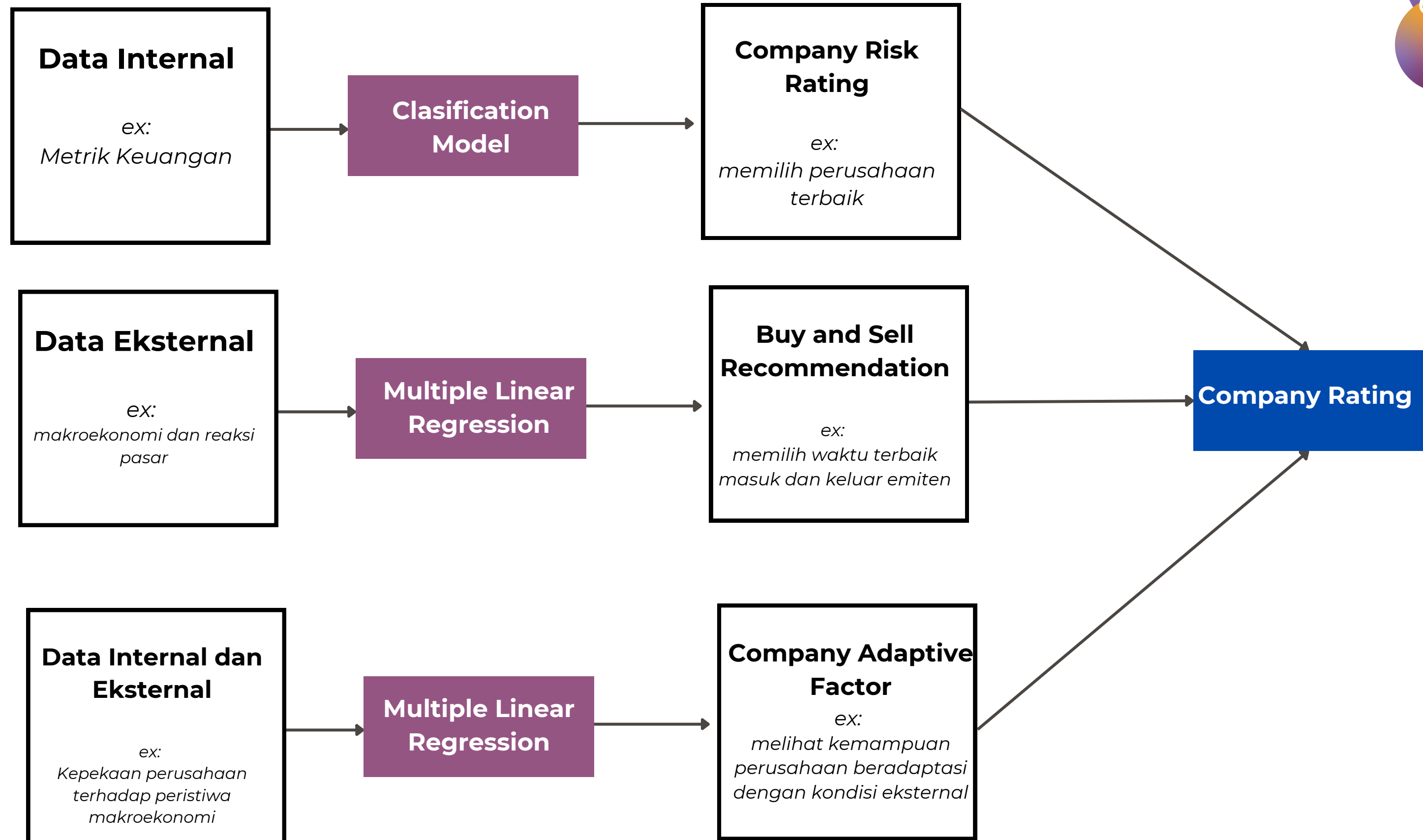
Dalam dunia investasi saham, **fluktuasi pasar** menjadi perhatian yang **mempengaruhi keputusan investor**. Disini **data cara pasar bereaksi** terhadap driver eksternal maupun internal menjadi sebuah **aset berharga bagi investor**.

Untuk memberikan rekomendasi investasi terbaik, maka data tersebut harus diolah dan dianalisa menggunakan permodelan data.

Analytic Approach

Untuk analytic approach dari model ini akan digunakan gabungan antara **Classification Model** untuk menilai kekuatan internal setiap emiten didalam sektor dan juga **Multiple Linear Regression** untuk melakukan predictive analysis terhadap sebuah insentif dan reaksi pasar terhadap emiten.

Dengan dilakukannya dua metode ini diharapkan bisa membantu investor dalam proses pemilihan emiten dan juga kapan waktu yang optimal untuk masuk ataupun keluar dari saham tersebut.



Data Requirements

Internal

Data internal yang akan didapatkan akan memberikan kesimpulan bagaimana kemampuan perusahaan mengelola sumber daya mereka dan bagaimana kemampuan mereka menghasilkan profit. Hal ini sangat penting bagi investor untuk memilih emiten mana yang ingin mereka investasikan.

Metrik yang akan digunakan

- Solvabilitas (Rasio hutang)
- Likuiditas (Rasio Kas)
- Profitabilitas (Rasio profit)

Data yang akan diolah

- Aset lancar
- Aset tetap
- Hurang lancar
- Hutang jangka panjang
- Ekuitas
- Pendapatan
- Beban-beban
- Profit
- Harga saham

Data collection :

Bursa Efek Indonesia, Yahoo! Finance, Company, Google Finance

Data Requirements & Collection

8

Eksternal

Data yang menguraikan situasi dan kondisi berada di luar perusahaan/oragnisasi yang mempengaruhi nilai dari suatu harga saham.

Data yang akan diolah

- Krisis Ekonomi (Trend)
- Harga CPO internasional
- Nilai mata uang (Dollar dan Rupiah)
- Kebijakan pemerintah
- Kepentingan investor
- Konflik geopolitik
- Ekonomi negara (GDP dan BI Rate)
- Energi alternatif

Data collection :

Portal Berita, Company Financial Report, Bank Indonesia, Bursa Efek Indonesia, Trading Economics

Data Collection

8

Portal Berita (Structured and Unstructured)

Ex: , <https://market.bisnis.com/>, <https://www.cnbcindonesia.com/market>,
<https://www.idxchannel.com/news>

Company Financial Report (Structured)

Ex: <https://www.astra-agro.co.id/laporan-tahunan/>, <https://www.andiraagro.com/id/annual-report>

Bank Indonesia (Structured)

Ex: <https://www.bi.go.id/id>

Bursa Efek Indonesia (Structured)

Ex: <https://www.idxchannel.com>

Trading Economics (Structured)

Ex: <https://tradingeconomics.com/commodities>

Terima Kasih

