

**PENERAPAN REGRESI NONPARAMETRIK DENGAN TAKSIRAN
KUADRAT TERKECIL UNTUK MENDETEKSI LONCATAN HARGA
SAHAM LEMBAGA KEUANGAN (BANK) DI INDONESIA**

Abd. Aziz

NIM: 4143230001

ABSTRAK

Model regresi sederhana dengan loncatan dalam peubah respon Y adalah gabungan dua atau lebih segmen garis regresi dimana segmen garis yang berdekatan mempunyai koefisien regresi yang berbeda. Metode pendeteksi loncatan yang akan dibahas dalam skripsi ini didasarkan pada penggunaan regresi nonparametrik dengan taksiran kuadrat terkecil. Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui ada atau tidaknya loncatan terhadap saham lembaga keuangan (Bank) di Indonesia. Penelitian ini menggunakan data sekunder harga saham pada lembaga keuangan dengan rentang waktu selama setahun yaitu data setiap harinya. Berdasarkan analisis data dengan menggunakan metode penerapan ini diperoleh bahwa pada Bank BCA dan Bank BRI tidak terjadi loncatan artinya bahwa pergerakan harga saham tersebut stabil atau sedikit faktor-faktor yang mempengaruhinya. Sedangkan pada Bank BNI mengalami loncatan dengan nilai $u_1 = 2,272$ dan nilai $d = 8$ maka disimpulkan harga saham mengalami loncatan pada akhir Agustus sampai awal Oktober, dengan artian ada terdapat faktor-faktor yang mempengaruhinya harga saham tersebut.

Kata kunci: Regresi non Parametrik, Loncatan, Kuadrat Terkerkecil.

