

ABSTRAK

Alex Elrado Nainggolan, NIM. 7123210003. Penggunaan Metode Pohon Keputusan Untuk Pengambilan Keputusan Investasi Saham Pada Bursa Efek Indonesia. Skripsi Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Medan.

Permasalahan dalam penelitian ini adalah bagaimana cara menentukan pengambilan keputusan investasi saham menggunakan metode pohon keputusan dengan menggunakan nilai return saham harian secara akurat. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah metode pohon keputusan dapat digunakan dalam pengambilan keputusan investasi saham.

Objek penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang terdaftar dalam bursa efek Indonesia tahun 2014. Jumlah Sampel dalam penelitian ini ada sebanyak 64 perusahaan, dimana metode yang digunakan dalam penarikan sampel ialah *purposive sampling* yang mana merupakan metode penarikan sampel dengan menggunakan kriteria, Analisis data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan grafik pohon keputusan dan pengukuran kesalahan peramalan. Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yang diperoleh dari www.idx.co.id dengan mengolah data melalui bantuan *QM for Windows 4*.

Berdasarkan hasil uji grafik pohon keputusan diperoleh bahwa prediksi nilai *return* saham (*EMV*) tidak sama dengan nilai aktual *return* saham. Dimana hasil penelitian ini selama 10 periode pengamatan, saham MTFN memiliki nilai *EMV* yang terbaik tetapi tidak sama dengan nilai *actual return*, dimana pada hari pertama dimiliki oleh saham INDF sebesar 0.1037, hari kedua oleh saham CTRA sebesar 0.0492, hari ketiga oleh saham INVS sebesar 0.0714, hari keempat oleh saham APLN sebesar 0.1671, hari kelima oleh saham LSIP sebesar 0.0548, hari keenam oleh saham BRAU sebesar 0.0845, hari ketujuh oleh saham MPPA sebesar 0.0309, hari kedelapan oleh saham MNCN sebesar 0.0841, hari kesembilan oleh saham TELE sebesar 0.0387 dan hari kesepuluh oleh saham DOID sebesar 0.1203. Sehingga disimpulkan metode pohon keputusan ini tidak dapat digunakan sebagai dasar pengambilan keputusan investasi saham.

Kata kunci : *Return Saham, Keputusan Investasi, Metode Pohon Keputusan*

ABSTRACT

Alex Elrado Nainggolan, NIM. 7123210003. Using Decision Tree Method for Stock Investment Decision Making In Indonesia Stock Exchange, Thesis Department of Management Faculty of Economics, State University of Medan.

The problem in this research was how to determine stock investment decisions using decision tree method by using the value of the daily stock returns with accurately. This study aims to determine whether the decision tree method can be used in stock investment decisions.

The object of this research is all companies which listed in Indonesia Stock Exchange period 2014. The sum of samples for this research is 64 companies, in which the methods to take the research sample is purposive sampling which is a sampling method using the criteria, analysis of the data used in this study uses a decision tree graph forecasting and measurement error. The data used in this research is secondary data obtained from www.idx.co.id by processing the data through the help of QM for Windows 4.

Based on the test results of the decision tree graph shows that the predictive value of stock returns (EMV) is not equal to the actual value of stock returns. Where the results of this study for 10 observation period, the stock MTFN value EMV the best but not the same as the value of the actual return, where the first day is owned by stock INDF at 0.1037, the second day by shares CTRA at 0.0492, the third day by shares INVS at 0.0714 , the fourth day by shares APLN at 0.1671, the fifth day by LSIP shares amounting to 0.0548, the sixth day by shares BRAU at 0.0845, the seventh day the stock MPPA amounted to 0.0309, the eighth by stock MNCN at 0.0841, the ninth day of the stock TELE at 0.0387 and day tenth by DOID shares amounting to 0.1203. Thus concluded this decision tree method can not be used as the basis for stock investment decisions.

Keywords: Return Stocks, Investment Decision, Decision Tree Method