

ABSTRAK

METODE DUA PARAMETER HOLT TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN MENGGUNAKAN SISTEM PEMANTAUAN (*TRACKING SIGNAL*) DARI TRIGG

Oleh

Ade Ernis

24010118120017

Analisis data deret waktu menggunakan Metode Pemulusan Eksponensial Ganda merupakan analisis data yang dipengaruhi oleh pola data *trend*. Metode Dua-Parameter dari Holt merupakan metode peramalan yang mengasumsikan pola data bersifat *trend* linier. Penelitian ini bertujuan untuk memodelkan dan mendapatkan hasil peramalan data deret waktu penutupan IHSG dengan menggunakan Metode Pemulusan Eksponensial Ganda: Dua-Parameter dari Holt. Hasil peramalan diverifikasi menggunakan Sistem Pemantauan (*Tracking Signal*) dari Trigg. Hasil penelitian menunjukkan bahwa Metode Pemulusan Eksponensial Ganda: Dua-Parameter dari Holt dengan nilai MAPE sebesar 3,3% memiliki ukuran akurasi peramalan yang sangat baik sehingga metode tersebut layak digunakan untuk meramalkan data penutupan IHSG. Berdasarkan pemantauan menggunakan *tracking signal* diperoleh tiga hasil peramalan yang bersifat bias. Metode Pemulusan Eksponensial Ganda: Dua-Parameter dari Holt digunakan untuk meramalkan 5 periode ke depan yaitu Januari 2022, Februari 2022, Maret 2022, April 2022 dan Mei 2022. Hasil peramalan 5 periode ke depan mengalami kenaikan secara berturut-turut.

Kata Kunci : Pemulusan Dua Parameter dari Holt, Peramalan, *Tracking Signal*