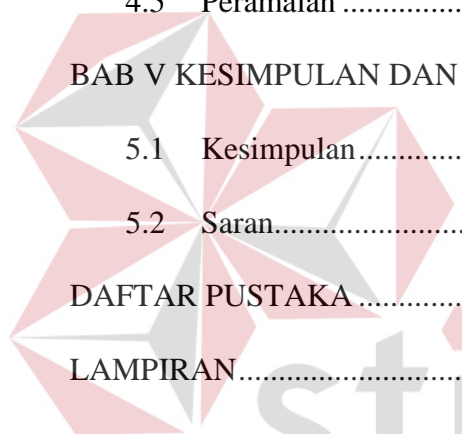


DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK.....	i
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah.....	3
1.3 Pembatasan Masalah.....	3
1.4 Tujuan Penelitian.....	4
1.5 Manfaat Penelitian.....	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	4
BAB II LANDASAN TEORI.....	6
2.1 Saham.....	6
2.1.1 Jenis – Jenis Saham	6
2.1.2 Harga Saham	8
2.1.3 Faktor-faktor yang mempengaruhi pergerakan harga saham ...	9
2.1.4 Analisis Saham	10
2.2 Peramalan	11
2.2.2 Macam-macam Peramalan	11
2.2.3 Proses Peramalan.....	12

2.2.4	Teknik Pengumpulan Data	14
2.3	Metode Arima.....	16
2.3.1	Model Autoregressive.....	18
2.3.2	Stasioner dan Non-stasioner	18
2.3.3	Pola autokorelasi.....	19
2.3.4	<i>Autocorrelation Function (ACF)</i>	21
2.3.5	<i>Partial Autocorrelation Function (PACF)</i>	21
2.3.6	<i>Differencing</i>	21
2.3.7	<i>White Noise</i>	22
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		24
3.1	Jenis / Pendekatan Penelitian.....	24
3.2	Sumber Data Penelitian.....	24
3.2.1	Data Penelitian.....	27
3.3	Teknik Pengumpulan Data.....	31
3.4	Studi Literatur.....	33
3.5	Pengolahan Data.....	34
3.6	Diagram Alir ARIMA	36
BAB IV HASIL PEMBAHASAN DAN EVALUASI		38
4.1	Identifikasi Model	38
4.2	Estimasi Model.....	52
	Model 1 : ARIMA (1,1,0).....	53
	Model 2 : ARIMA (1,1,1).....	54
	Model 3 : ARIMA (0,1,1).....	55
	Model 4 : ARIMA (2,1,1).....	57

Model 5 : ARIMA (2,1,0).....	59
4.3 Uji Asumsi Residual (diagnostic checking)	60
Model Arima (1,1,0).....	60
Model Arima (1,1,1).....	61
Model Arima (0,1,1).....	61
Model Arima (2,1,1).....	62
Model Arima (2,1,0).....	62
4.4 Pemilihan Model Terbaik ARIMA.....	63
4.5 Peramalan	64
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	71
5.1 Kesimpulan.....	71
5.2 Saran.....	71
DAFTAR PUSTAKA	72
LAMPIRAN.....	75



INSTITUT BISNIS
& INFORMATIKA
stikom
SURABAYA

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 3.1 Data Harga Perusahaan Ciputra Tahun 2009.....	28
Tabel 3.2 Data Harga Perusahaan Ciputra Tahun 2010.....	28
Tabel 3.3 Data Harga Perusahaan Ciputra Tahun 2011.....	29
Tabel 3.4 Data Harga Perusahaan Ciputra Tahun 2012.....	29
Tabel 3.5 Data Harga Perusahaan Ciputra Tahun 2013.....	30
Tabel 3.6 Data Harga Perusahaan Ciputra Tahun 2014.....	30
Tabel 4.1 Hasil <i>Autocorrelation Function</i> Harga Saham Ciputra.	42
Tabel 4.2 <i>Partial Autocorrelation Function</i> Harga Saham Ciputra.....	45
Tabel 4.3 Hasil <i>Autocorrelation Function</i> Diferensiasi 1 Harga Saham Perusahaan Properti Ciputra	49
Tabel 4.4 Hasil <i>Partial Autocorrelation Function</i> diferensiasi 1 Harga Saham Perusahaan Properti Ciputra.....	51
Tabel 4.5 Estimasi Parameter ARIMA (1,1,0).....	53
Tabel 4.6 Estimasi Parameter ARIMA (1,1,1).....	54
Tabel 4.7 Estimasi Parameter ARIMA (0,1,1).....	55
Tabel 4.8 Estimasi Parameter ARIMA (2,1,1).....	57
Tabel 4.9 Estimasi Parameter ARIMA (2,1,0).....	59
Tabel 4.10 Uji Ljung-Box ARIMA (1,1,0).....	60
Tabel 4.11 Uji Ljung-Box ARIMA (1,1,1).....	61
Tabel 4.12 Uji Ljung-Box ARIMA (0,1,1).....	61
Tabel 4.13 Uji Ljung-Box ARIMA (2,1,1).....	62

Tabel 4.14 Uji Ljung-Box ARIMA (2,1,1).....	62
Tabel 4.15 Ringkasan Hasil Estimasi dan pengecekan Model ARIMA (Harga Saham Perusahaan Property Ciputra. CTRP.JK)	63
Tabel 4.16 Hasil Uji Coba Peramalan ARIMA (0,1,1).....	64
Tabel 4.17 Hasil Evaluasi Uji Coba Peramalan Model ARIMA (0,1,1).....	65
Tabel 4.18 Hasil Uji Coba Peramalan ARIMA (2,1,1).....	66
Tabel 4.19 Hasil Evaluasi Uji Coba Peramalan Model ARIMA (2,1,1).....	67
Tabel 4.20 Hasil Evaluasi Uji Coba Peramalan Oleh <i>Broker</i>	69
Tabel 4.21 Perbandingan Tingkat Kesalahan Hasil Peramalan	70



DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 3.1 Halaman Awal <i>Yahoo Finance</i>	25
Gambar 3.2 Halaman <i>Historical Prices</i> Ciputra Property Tbk.....	26
Gambar 3.3 Halaman Unduh Data Dalam Format <i>Spreadsheet</i>	27
Gambar 3.4 File Data Awal Setelah Pengunduhan.....	31
Gambar 3.5 Data Asli Sebelum Diolah.....	32
Gambar 3.6 Data Yang Siap Untuk Diolah.....	33
Gambar 3.7 Diagram Alir ARIMA	36
Gambar 4.1 Memasukan Data Asli Kedalam Minitab	38
Gambar 4.2 Proses <i>Time Series Plot</i>	39
Gambar 4.3 <i>Time Series plot</i>	39
Gambar 4.4 Langkah Proses <i>Autocorrelation</i>	40
Gambar 4.5 Pengaturan <i>Autocorrelation Function</i> Harga Saham Ciputra	40
Gambar 4.6 Hasil <i>Autocorrelation Function</i> Harga Saham Ciputra.....	41
Gambar 4.7 Langkah proses <i>Partial Autocorrelation</i>	43
Gambar 4.8 <i>Partial Autocorrelation Function</i> Data Asli	43
Gambar 4.9 Hasil <i>Partial Autocorrelation Function</i>	44
Gambar 4.10 Proses Diferensiasi 1	46
Gambar 4.11 Pengaturan Diferensiasi.....	47
Gambar 4.12 <i>Time Series Plot</i> Diferensiasi 1	47
Gambar 4.13 Diferensiasi 1 (<i>ACF</i>)	48
Gambar 4.14 <i>Partial Autocorrelation Function</i> Diferensiasi 1	50

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Data Harga Saham Ciputra	75

