

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN I</b> .....	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN II</b> .....	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>v</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1    Latar Belakang.....	1
1.2    Rumusan Masalah.....	5
1.3    Batasan Masalah .....	6
1.4    Tujuan Penelitian .....	6
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b> .....	<b>7</b>
2.1    Saham.....	7
2.2    Indeks Harga Saham .....	7
2.3    Peramalan.....	9
2.4    Analisis Runtun Waktu .....	10
2.5    Stasioneritas Data .....	11
2.5.1    Stasioneritas dalam varians .....	11
2.5.2    Stasioneritas dalam <i>mean</i> .....	17
2.6    Fungsi Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial .....	19
2.6.1 <i>Autocorrelation Function</i> (ACF).....	20
2.6.2 <i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF).....	20
2.7    Model Runtun Waktu.....	21
2.7.1    Model <i>Autoregressive</i> (AR) .....	22
2.7.2    Model <i>Moving Average</i> (MA).....	22
2.7.3    Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA) .....	23
2.7.4    Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA) .....	24

2.8	Pemodelan ARIMA .....	25
2.8.1	Identifikasi Model.....	25
2.8.2	Estimasi Parameter .....	25
2.8.3	Uji Signfikansi Parameter .....	28
2.8.4	Uji Diagnostik .....	29
2.8.5	Pemilihan Model Terbaik.....	32
2.9	Logika <i>Fuzzy</i> .....	33
2.10	Himpunan Fuzzy ( <i>Fuzzy Set</i> ) .....	34
2.11	Fungsi Keanggotaan ( <i>Membership Function</i> ).....	35
2.12	<i>Fuzzy Time Series</i> .....	40
2.13	<i>Fuzzy Time Series Markov Chain</i> .....	41
2.14	Ketepatan Hasil Peramalan .....	49
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>		<b>51</b>
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	51
3.2	Variabel Penelitian.....	51
3.3	Tahapan Analisis Data .....	51
3.4	Diagram Alir Analisis Data.....	53
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>56</b>
4.1	Analisis Deskriptif Data.....	56
4.2	Stasioneritas.....	57
4.2.1	Transformasi Box-Cox.....	57
4.2.2	Uji Akar Unit <i>Augmented Dickey-Fuller</i> .....	58
4.3	Identifikasi Model ARIMA .....	59
4.4	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA.....	60
4.5	Uji Asumsi Model.....	62
4.5.1	Uji Independensi Residual .....	62
4.5.2	Uji Normalitas Residual.....	63
4.5.3	Uji Homoskedastisitas Residual .....	64
4.5.4	Pemilihan Model Terbaik ARIMA.....	65
4.6	<i>Fuzzy Time Series Markov Chain</i> .....	66
4.6.1	Menentukan Himpunan Semesta $U$ .....	66
4.6.2	Pembentukan Interval .....	67

4.6.3	Menentukan Himpunan <i>Fuzzy</i> .....	68
4.6.4	Fuzzifikasi Data.....	69
4.6.5	Pembentukan FLR dan FLRG.....	70
4.6.6	Pembentukan Matriks Probabilitas Transisi.....	71
4.6.7	Menghitung Nilai Peramalan Awal .....	72
4.6.8	Penyesuaian Nilai Peramalan .....	73
4.6.9	Menghitung Nilai Peramalan Akhir.....	74
4.7	Perbandingan ARIMA dan <i>Fuzzy Time Series Markov Chain</i> .....	75
4.8	Pemilihan Metode Terbaik .....	76
4.9	Peramalan Data <i>Testing</i> .....	76
4.10	Ketepatan Hasil Peramalan .....	77
4.11	Peramalan Periode Selanjutnya .....	78
<b>BAB V PENUTUP .....</b>		<b>80</b>
5.1	Kesimpulan.....	80
5.2	Saran .....	80
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>		<b>82</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>		<b>85</b>