

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Batasan Masalah	7
1.4 Tujuan Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1 Harga Saham.....	8
2.2 Peramalan.....	9
2.3 <i>Time Series</i>	9
2.4 Stasioneritas	11
2.4.1 Stasioneritas dalam Varian.....	11
2.4.2 Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	17
2.5 Fungsi Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial.....	20
2.5.1 Fungsi Autokorelasi	20
2.5.2 Fungsi Autokorelasi Parsial	21
2.6 <i>Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)</i>	22
2.6.1 Model <i>Autoregressive (AR)</i>	23
2.6.2 Model <i>Moving Average (MA)</i>	24
2.6.3 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)</i>	25
2.7 Identifikasi Model ARIMA.....	26
2.8 Estimasi Parameter.....	26

2.9	Uji Signifikansi Parameter	30
2.10	Pemeriksaan Diagnostik.....	32
2.10.1	Uji Independensi Residual	32
2.10.2	Uji Normalitas Residual.....	33
2.10.3	Uji Homoskedastisitas Residual.....	34
2.11	Logika <i>Fuzzy</i>	35
2.12	Himpunan <i>Fuzzy</i>	36
2.13	Fungsi Keanggotaan.....	38
2.14	<i>Fuzzy Time Series</i> Saxena Easo	42
2.15	Ketepatan Hasil Peramalan	47
BAB III METODE PENELITIAN.....		49
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	49
3.2	Variabel Penelitian.....	49
3.3	Tahapan Analisis Data	49
3.4	Diagram Alir Analisis Data	52
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		54
4.1	Analisis Data Eksploratif.....	54
4.2	Metode ARIMA	56
4.2.1	Stasioneritas	56
4.2.2	Identifikasi Model	58
4.2.3	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter.....	59
4.2.4	Pemeriksaan Diagnostik.....	60
4.2.5	Model ARIMA Terbaik.....	63
4.3	<i>Fuzzy Time Series</i> Metode Saxena Easo.....	64
4.4	Pemilihan Metode Terbaik Berdasarkan RMSE Terkecil	71
4.5	Peramalan Menggunakan Metode Terbaik	72
4.6	Evaluasi Kinerja Model	73
BAB V PENUTUP.....		75
5.1.	Kesimpulan	75
5.2.	Saran	76
DAFTAR PUSTAKA		77
LAMPIRAN.....		80