

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN I .....	iii
HALAMAN PENGESAHAN II .....	iv
KATA PENGANTAR .....	v
ABSTRAK .....	vi
ABSTRACT .....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	5
1.3 Batasan Masalah.....	5
1.4 Tujuan Penelitian .....	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Saham.....	7
2.2 Analisis Runtun Waktu .....	8
2.3 Stasioneritas .....	9

2.3.1 Stasioneritas dalam Varian.....	9
2.3.2 Stasioneritas dalam <i>Mean</i> .....	10
2.4 Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial.....	12
2.4.1 Fungsi Autokorelasi (ACF).....	12
2.4.2 Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	13
2.5 Model <i>Time series</i> Stasioner .....	14
2.5.1 Model Autoregressive (AR).....	14
2.5.2 Model Moving Average (MA).....	15
2.5.3 Model Autogressive Moving Average (ARMA) .....	16
2.6 Model <i>Time series</i> Tidak Stasioner.....	17
2.6.1 Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA).....	17
2.6.2 Model Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average (ARFIMA) .....	18
2.7 Pemodelan ARFIMA .....	20
2.7.1 Identifikasi <i>Long memory</i> .....	21
2.7.2 Estimasi Parameter Pembada ( <i>d</i> ) dengan Metode Geweke Porter-Hudak (GPH).....	23
2.8 Estimasi Parameter Model .....	24
2.9 Uji Signifikansi Parameter .....	26
2.10 Uji Normalitas Residual.....	28
2.11 Uji Independensi Residual .....	28

2.12 Uji Homogenitas Residual .....	30
2.13 Evaluasi Model.....	31
2.14 <i>Forecasting</i> .....	32
BAB III METODE PENELITIAN.....	33
3.1 Jenis dan Sumber Data .....	33
3.2 Variabel Penelitian .....	33
3.3 Tahapan Analisis Data .....	33
3.4 Diagram Alir Analisis Data.....	35
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....	37
4.1 Statistik Deskriptif .....	37
4.2 Stasioneritas .....	38
4.2.1 Stasioneritas dalam Varian.....	38
4.2.1 Stasioneritas dalam <i>Mean</i> .....	40
4.3 Identifikasi Pola <i>Long memory</i> .....	41
4.4 Estimasi Parameter Pembeda (d) .....	42
4.5 Identifikasi Model .....	43
4.5 Estimasi Parameter Model .....	45
4.7 Uji Signifikansi Parameter Model.....	45
4.8 Uji Normalitas Residual.....	47
4.9 Uji Independensi Residual .....	48
4.10 Uji Homogenitas Residual .....	49

4.11 Evaluasi Model.....	50
4.12 Hasil Peramalan .....	51
4.13 <i>Graphical User Interface</i> (GUI) .....	52
BAB V PENUTUP.....	61
5.1 Kesimpulan .....	61
5.2 Saran.....	62
DAFTAR PUSTAKA .....	63
LAMPIRAN.....	66