

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	iii
HALAMAN PENGESAHAN II	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Batasan Masalah	8
1.4 Tujuan Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Investasi	9
2.1.1. Pengertian dan Jenis Investasi	9
2.1.2. Pasar Modal	10
2.1.3. Saham dan <i>Index</i> Saham	11
2.2 Peramalan (<i>Forecasting</i>)	13
2.2.1 Pengertian Peramalan	13
2.2.2 Metode Peramalan	14
2.3 Analisis Deret Berkala (<i>Time Series</i>)	16

2.3.1 Pola Data Deret Berkala (<i>Time Series</i>).....	16
2.3.2. Pengujian Stasioneritas Data <i>Time Series</i>	19
2.3.3. Fungsi Autokorelasi (ACF)	24
2.3.4 Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF)	25
2.4. Model-model <i>Time Series</i> Stasioner.....	28
2.4.1. Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	28
2.4.2. Model <i>Moving Average</i> (MA)	29
2.4.3. Model <i>Autoregressive Moving Average</i> atau ARMA (p,q)	29
2.5. Model-model <i>Time Series</i> Non-Stasioner	30
2.5.1. Metode <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> atau ARIMA (p,d,q).....	30
2.5.2. Identifikasi Model.....	30
2.4.2. Estimasi Parameter Model	31
2.4.3 Uji Asumsi Model.....	32
2.4.4. Pemilihan Model Terbaik	36
2.5. Metode <i>Exponential Smoothing</i>	37
2.5.1 <i>Single Exponential Smoothing/SES</i>	37
2.5.2 <i>Double Exponential Smoothing Brown/DES Brown</i>	39
2.5.3 <i>Double Exponential Smoothing Holt/DES Holt</i>	40
2.6. Perhitungan <i>Mean Absolute Error</i> (MAE) dan <i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE).....	42
2.6.1 <i>Mean Absolute Error</i> (MAE).....	42
2.6.2 <i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE)	42
BAB III METODE PENELITIAN.....	44
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	44
3.2 Variabel Penelitian.....	44

3.3	Tahapan Analisis Data	45
3.4	Diagram Alir Analisis Data	47
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		49
4.1	Pola Data <i>Jakarta Islamic Index</i>	49
4.2	Stasioneritas	50
4.2.1	Stasioneritas dalam varian	50
4.2.2	Stasioneritas dalam mean	51
4.3	Identifikasi Model ARIMA	52
4.3.1	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA	53
4.3.2	Uji Asumsi Model ARIMA	55
4.3.3	Pemilihan Model ARIMA Terbaik	59
4.3.4	Peramalan dengan Model ARIMA Terbaik	60
4.4	Identifikasi Model <i>Double Exponential Smoothing</i>	60
4.4.1	Menentukan Nilai α dan β	60
4.4.2	Menghitung Nilai Penghalusan <i>level (St)</i> dan <i>Trend (bt)</i>	61
4.4.3	Menghitung Nilai Peramalan	62
4.5	Penentuan Model Peramalan Terbaik	64
4.6	Perhitungan Peramalan Data Testing Menggunakan Model Terbaik	64
4.7	Evaluasi Kinerja Model Terbaik	65
BAB V PENUTUP		67
5.1.	Kesimpulan	67
DAFTAR PUSTAKA		68
LAMPIRAN		71