

**PENERAPAN MODEL *AUTOREGRESSIVE FRACTIONALLY  
INTEGRATED MOVING AVERAGE DENGAN EFEK GARCH*  
(ARFIMA-GARCH) UNTUK PREDIKSI HARGA SAHAM  
PT BANK CENTRAL ASIA TBK**



**SKRIPSI**

**Disusun Oleh:**

**Imanuella Arkadia**

**24050119140127**

**DEPARTEMEN STATISTIKA  
FAKULTAS SAINS DAN MATEMATIKA  
UNIVERSITAS DIPONEGORO  
SEMARANG  
2024**