

UNIVERSITAS BINA NUSANTARA

Program Ganda
Teknik Informatika Dan Matematika
Skripsi Sarjana Program Ganda
Semester Ganjil 2009/2010

ANALISIS PERGERAKAN HARGA SAHAM LQ 45 MENGUNAKAN METODE *AUTOREGRESSIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE* BERBASIS KOMPUTER

ALEX
0900789580

ABSTRAK

Analisis Teknikal merupakan salah satu metode yang dapat digunakan untuk mengetahui kondisi pasar dan melakukan prediksi pasar kedepan. Meskipun banyak digunakan oleh investor, tetapi penelitian mengenai analisis teknikal di Indonesia masih sangat jarang. Analisis teknikal yang dimaksud adalah metode ARIMA yang digunakan penulis untuk memprediksi pergerakan harga saham dengan menggunakan bantuan program komputer. Prediksi dengan ARIMA diawali dengan mencari nilai *Acf* dan *Pacf* untuk mengidentifikasi model. Kemudian melihat hasil selang kepercayaannya, jika data sudah stasioner maka dapat mengestimasi konstanta, koefisien *Autoregressive* dan koefisien *Moving Average*. Hasil yang didapatkan kemudian dimasukkan dalam sebuah persamaan linier untuk melakukan peramalan.

Dalam penelitian ini penulis mengambil data saham ANTAM selama 1 tahun terakhir lalu membuat perhitungan secara manual dan membandingkan dengan program yang dibuat dan hasilnya sama. Metode ini memiliki tingkat kesalahan sangat kecil yang diukur berdasarkan MAPE (*Mean Absolut Percentage Error*) yaitu 5.2%.

Hasil analisis pergerakan harga saham dengan metode ini mendapatkan sebuah model persamaan yang cocok digunakan untuk meramal saham pertambangan yang dapat dilihat pada grafik time series. Sehingga investor dapat mengambil keputusan yang tepat dan mengoptimalkan keuntungan dalam berinvestasi di bursa saham.

Kata Kunci : Harga saham LQ45, ARIMA (*Autoregressive Integrated Moving Average*), *Autoregressive*, *Moving Average*.