

## ABSTRAKSI

Investasi di pasar modal memerlukan banyak informasi yang mempengaruhi harga saham. Dengan demikian diperlukan analisis teknikal yang merupakan alat yang digunakan untuk memprediksi pergerakan harga saham. Penelitian ini difokuskan pada peramalan saham perbankan harian, khususnya untuk BMRI, BBRI, BBNI dan BBCA periode 3 Januari 2005 sampai dengan 30 Desember 2014 dengan metode ARIMA yang selanjutnya akan diuji akurasi hasil peramalannya. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa data keempat saham perbankan harian selama periode 2005 sampai 2014 merupakan data yang bersifat tidak stasioner. Setelah dilakukan *difference* satu kali maka data menjadi stasioner. Hasil *runs test* menunjukkan bahwa data harga saham BMRI, BBRI, BBNI dan BBCA tidak mengikuti pola acak. Hasil uji *correlogram* didapatkan *partial autocorrelation* yang signifikan mempengaruhi harga saham BMRI, BBRI, BBNI dan BBCA. Model yang terbaik adalah ARIMA(2,1,2) tanpa konstanta untuk BMRI, ARIMA(0,1,4) tanpa konstanta untuk BBRI, ARIMA(4,1,4) tanpa konstanta untuk BBNI dan ARIMA(2,1,2) dengan konstanta untuk BBCA. Keempat saham perbankan memiliki nilai MAPE kurang dari 10% yang menunjukkan bahwa hasil peramalan sangat akurat.

Keyword: autokorelasi, peramalan, ARIMA

## ***ABSTRACT***

Investing in the stock market requires a lot of information that influence stock prices. Therefore technical analysis is a tool used to predict stock price movements. This study focused on banking stocks daily forecasting, especially for BMRI, BBRI, BBNI and BBCA with the period January 3, 2005 until December 30, 2014 with ARIMA method which will further test the accuracy of forecasting results. Results of this study indicate that the data fourth daily banking stocks during the period 2005 to 2014 is data that is not stationary. After difference one then the data becomes stationary. Results of runs test showed that the stock price BMRI, BBRI, BBNI and BBCA not follow a random walk. Results of correlogram test obtained partial autocorrelation significantly affect stock prices BMRI, BBRI, BBNI and BBCA. The best model is ARIMA (2,1,2) without constant for BMRI, ARIMA (0,1,4) without constant for BBRI, ARIMA (4,1,4) without constant for BBNI and ARIMA (2,1,2) with constants for BBCA. Fourth banking stocks have MAPE value of less than 10% which shows that the results are highly accurate forecast.

Keywords: autocorrelation, forecasting, ARIMA