

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	iii
HALAMAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
KATA PENGANTAR	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
ABSTRAKSI	viii
<i>ABSTRACT</i>	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	8
2.1 Saham Perbankan	8
2.2 Peramalan	9
2.3 Analisis Teknikal.....	10
2.4 Model ARIMA	13
2.5 Penelitian Terdahulu.....	15
2.6 Pengembangan Hipotesis	16
BAB III METODA PENELITIAN	18
3.1 Populasi dan Sampel Penelitian	18
3.2 Periode Penelitian.....	18
3.3 Jenis Data	19
3.4 Metode Pengumpulan Data	19
3.5 Metode Analisis Data	19
3.5.1 <i>Runs Test</i>	19

3.5.2	Metode ARIMA	20
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		26
4.1	Analisis Bank Mandiri (BMRI).....	26
4.1.1	<i>Runs Test</i>	26
4.1.2	Analisis Deskriptif Data Saham BMRI.....	27
4.1.3	Uji Stasioneritas	28
4.1.4	Peramalan dengan Metode ARIMA.....	33
4.2	Analisis Bank BRI (BBRI).....	44
4.2.1	<i>Runs Test</i>	44
4.2.2	Analisis Deskriptif Data Saham BBRI.....	45
4.2.3	Uji Stasioneritas	46
4.2.4	Peramalan dengan Metode ARIMA.....	50
4.3	Analisis Bank BNI (BBNI)	62
4.3.1	<i>Runs Test</i>	62
4.3.2	Analisis Deskriptif Data Saham BBNI	63
4.3.3	Uji Stasioneritas	64
4.3.4	Peramalan dengan Metode ARIMA.....	68
4.4	Analisis Bank BCA (BBCA).....	80
4.4.1	<i>Runs Test</i>	80
4.4.2	Analisis Deskriptif Data Saham BBCA	81
4.4.3	Uji Stasioneritas	82
4.4.4	Peramalan dengan Metode ARIMA.....	86
4.5	Pembahasan Hasil Penelitian.....	93
BAB V Kesimpulan dan Saran		96
5.1	Kesimpulan.....	96
5.2	Keterbatasan Penelitian	97
5.3	Saran	97
DAFTAR PUSTAKA		98
LAMPIRAN.....		101

DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1 Runs Test pada saham BMRI	26
Tabel 4. 2 Uji unit root harga saham BMRI pada tingkat level	29
Tabel 4. 3 Uji unit root harga saham BMRI pada tingkat difference.....	31
Tabel 4. 4 Hasil uji signifikansi pada semua kemungkinan model ARIMA saham BMRI	36
Tabel 4. 5 Hasil uji diagnostic checking saham BMRI.....	41
Tabel 4. 6 Hasil uji statistik Breusch Godfrey LM ARIMA(2,1,2) tanpa konstanta	42
Tabel 4. 7 Output ARIMA(2,1,2) tanpa konstanta	42
Tabel 4. 8 Runs test pada saham BBRI.....	44
Tabel 4. 9 Uji unit root harga saham BBRI pada tingkat level	47
Tabel 4. 10 Uji unit root harga saham BBRI pada tingkat difference.....	48
Tabel 4. 11 Hasil uji signifikansi pada semua kemungkinan model ARIMA saham BBRI	53
Tabel 4. 12 Hasil uji diagnostic checking saham BBRI	59
Tabel 4. 13 Hasil uji statistik Breusch Godfrey LM ARIMA(0,1,4) tanpa konstanta	60
Tabel 4. 14 Output ARIMA(0,1,4) tanpa konstanta.....	61
Tabel 4. 15 Runs test pada saham BBNI	62
Tabel 4. 16 Uji unit root harga saham BBNI pada tingkat level.....	65
Tabel 4. 17 Uji unit root harga saham BBNI pada tingkat difference	66
Tabel 4. 18 Hasil uji signifikansi pada semua kemungkinan model ARIMA saham BBNI	71
Tabel 4. 19 Hasil uji diagnostic checking saham BBNI	77
Tabel 4. 20 Hasil uji statistik Breusch Godfrey LM ARIMA(4,1,4) tanpa konstanta	78
Tabel 4. 21 Output ARIMA(4,1,4) tanpa konstanta.....	78
Tabel 4. 22 Runs test pada saham BBKA	80
Tabel 4. 23 Uji unit root harga saham BBKA pada tingkat level	83



Tabel 4. 24 Uji unit root harga saham BBCA pada tingkat difference	84
Tabel 4. 25 Hasil uji signifikansi pada semua kemungkinan model ARIMA saham BBCA	88
Tabel 4. 26 Hasil uji diagnostic checking saham BBCA	91
Tabel 4. 27 Hasil uji statistik Breusch Godfrey LM ARIMA(2,1,2) dengan konstanta	92
Tabel 4. 28 Output ARIMA(2,1,2) dengan konstanta.....	92
Tabel 4. 29 Nilai Mean Absolute Percent Error (MAPE)	94

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2. 1 Tahapan pengujian Metode ARIMA.....	14
Gambar 4. 1 Plot data pergerakan harga saham BMRI pada tingkat level	27
Gambar 4. 2 Correlogram harga saham BMRI pada tingkat level.....	28
Gambar 4. 3 Plot data pergerakan harga saham BMRI pada tingkat difference...	30
Gambar 4. 4 Correlogram harga saham BMRI pada tingkat difference	32
Gambar 4. 5 Hasil peramalan harga saham BMRI	43
Gambar 4. 6 Plot data pergerakan harga saham BBRI pada tingkat level	45
Gambar 4. 7 Correlogram harga saham BBRI pada tingkat level.....	46
Gambar 4. 8 Plot data pergerakan harga saham BBRI pada tingkat difference....	48
Gambar 4. 9 Correlogram harga saham BBRI pada tingkat difference	49
Gambar 4. 10 Hasil peramalan harga saham BBRI	61
Gambar 4. 11 Plot data pergerakan harga saham BBNI pada tingkat level	63
Gambar 4. 12 Correlogram harga saham BBNI pada tingkat level	64
Gambar 4. 13 Plot data pergerakan harga saham BBNI pada tingkat difference .	66
Gambar 4. 14 Correlogram harga saham BBNI pada tingkat difference	67
Gambar 4. 15 Hasil peramalan harga saham BBNI	79
Gambar 4. 16 Plot data pergerakan harga saham BBKA pada tingkat level.....	81
Gambar 4. 17 Correlogram harga saham BBKA pada tingkat level	82
Gambar 4. 18 Plot data pergerakan harga saham BBKA pada tingkat difference	83
Gambar 4. 19 Correlogram harga saham BBKA pada tingkat difference.....	85
Gambar 4. 20 Hasil peramalan harga saham BBKA.....	93