

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
LEMBAR PENGESAHAN .....	ii
PERNYATAAN .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
DAFTAR ISI .....	vi
DAFTAR TABEL .....	viii
DAFTAR GAMBAR .....	ix
DAFTAR LAMPIRAN .....	x
INTISARI .....	xi
ABSTRACT .....	xii
I. PENDAHULUAN .....	1
1. Latar Belakang .....	1
2. Rumusan Masalah .....	5
3. Tujuan Penelitian .....	6
4. Manfaat Penelitian .....	6
II. TINJAUAN PUSTAKA DAN LANDASAN TEORI .....	7
1. Tinjauan Pustaka .....	7
2. Landasan Teori .....	9
2.1. Analisis teknikal .....	9
2.2. Saham .....	11
2.3. Sektor perikanan .....	12
2.4. Bursa Efek Indonesia (BEI) .....	13
2.4.1. Sejarah .....	13
2.4.2. Struktur pasar modal Indonesia dan struktur organisasi BEI .....	15
2.4.3. Perdagangan saham di BEI .....	15
2.5. Metode Box-Jenkins (ARIMA) .....	16
2.5.1. Model <i>autoregressive</i> .....	18
2.5.2. Model <i>moving average</i> .....	18
2.5.3. Model <i>autoregressive integrated moving average</i> (ARIMA) .....	19
2.5.4. Tahapan metode Box-Jenkins (ARIMA) .....	20
2.6. Metode pemulusan eksponensial linear ganda-Brown .....	24
3. Hipotesis .....	25
III. METODE PENELITIAN .....	27
1. Metode Dasar Penelitian .....	27
2. Jenis Data Dan Sumber Data .....	27
3. Definisi Operasional .....	27
4. Analisis Data .....	28
5. Uji Hipotesis .....	31
5.1. Pendekatan otokorelasi .....	31
5.2. Ukuran kesalahan peramalan .....	32
IV. GAMBARAN UMUM PERUSAHAAN .....	33
1. PT. Dharma Samudera Fishing Industries, Tbk. (DSFI) .....	33
1.1. Sejarah singkat .....	33
1.2. Visi dan misi .....	33
1.3. Struktur organisasi .....	34
1.4. Produk .....	34
1.5. Kinerja perusahaan .....	35
2. PT. Inti Agro Resources, Tbk. (IIRP) .....	35
2.1. Sejarah singkat .....	35
2.2. Visi dan misi .....	36



2.3. Struktur organisasi.....	37
2.4. Produk .....	37
2.5. Kinerja perusahaan.....	38
3. PT. Central Proteinaprima, Tbk. (CPRO) .....	39
3.1. Sejarah singkat.....	39
3.2. Visi dan misi .....	39
3.3. Struktur organisasi.....	40
3.4. Produk .....	40
3.5. Kinerja perusahaan.....	41
V. HASIL DAN PEMBAHASAN.....	42
1. Statistika Deskriptif .....	42
2. Analisis Data.....	43
2.1. Pemeriksaan kestasioneran data .....	43
2.2. Proses <i>differencing</i> (pembedaan) .....	46
2.3. Penentuan nilai p, d, dan q dalam ARIMA .....	48
2.4. Estimasi parameter model ARIMA .....	52
2.5. Peramalan .....	56
2.6. Pengukuran kesalahan peramalan .....	58
2.7. Membandingkan hasil peramalan .....	58
VI. KESIMPULAN DAN SARAN.....	61
1. Kesimpulan .....	61
2. Saran .....	61
DAFTAR PUSTAKA.....	63
LAMPIRAN .....	65

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1.	Kenaikan Harga Saham Industri Perkapalan (periode: 04 Desember 2013 - 04 Desember 2014) .....	1
Tabel 2.1.	Penelitian Terdahulu .....	8
Tabel 2.2.	Pola Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial .....	22
Tabel 5.1.	Statistika deskriptif harga saham penutupan bulanan DSFI, IIKP dan CPRO periode Oktober 2009 - September 2015 .....	43
Tabel 5.2.	Korelogram data harga saham penutupan bulanan DSFI periode Oktober 2009 - September 2015 .....	44
Tabel 5.3.	Korelogram data harga saham penutupan bulanan IIKP periode Oktober 2009 - September 2015 .....	44
Tabel 5.4.	Korelogram data harga saham penutupan bulanan CPRO periode Oktober 2009 - September 2015 .....	45
Tabel 5.5.	Hasil unit root test type ADF untuk data harga saham penutupan bulanan DSFI periode Oktober 2009 - September 2015 .....	45
Tabel 5.6.	Hasil unit root test type ADF untuk data harga saham penutupan bulanan IIKP periode Oktober 2009 - September 2015 .....	45
Tabel 5.7.	Hasil unit root test type ADF untuk data harga saham penutupan bulanan CPRO periode Oktober 2009 - September 2015 .....	46
Tabel 5.8.	Hasil unit root test type ADF untuk data harga saham DSFI setelah melalui 1 (satu) kali proses <i>differencing</i> .....	47
Tabel 5.9.	Hasil unit root test type ADF untuk data harga saham IIKP setelah melalui 1 (satu) kali proses <i>differencing</i> .....	48
Tabel 5.10.	Hasil unit root test type ADF untuk data harga saham CPRO setelah melalui 1 (satu) kali proses <i>differencing</i> .....	48
Tabel 5.11.	Korelogram data harga saham DSFI setelah melalui 1 (satu) kali proses <i>differencing</i> .....	49
Tabel 5.12.	Korelogram data harga saham IIKP setelah melalui 1 (satu) kali proses <i>differencing</i> .....	50
Tabel 5.13.	Korelogram data harga saham CPRO setelah melalui 1 (satu) kali proses <i>differencing</i> .....	51
Tabel 5.14.	Korelogram data harga saham DSFI model ARIMA (1,1,0) dan ARIMA (1,1,1) .....	52
Tabel 5.15.	Perbandingan model ARIMA (1,1,0) dan ARIMA (1,1,1) untuk data harga saham DSFI .....	53
Tabel 5.16.	Korelogram data harga saham IIKP model ARIMA (3,1,0) dan ARIMA (3,1,2) .....	53
Tabel 5.17.	Perbandingan model ARIMA (3,1,0) dan ARIMA (3,1,2) untuk data harga saham IIKP .....	54
Tabel 5.18.	Korelogram data harga saham CPRO model ARIMA (4,1,0) dan ARIMA (4,1,3) .....	55
Tabel 5.19.	Perbandingan model ARIMA (4,1,0) dan ARIMA (4,1,3) untuk data harga saham CPRO .....	55
Tabel 5.20.	MSE dan MPE hasil peramalan menggunakan metode ARIMA pada harga saham penutupan bulanan DSFI, IIKP dan CPRO periode Oktober 2009 - September 2015 .....	58
Tabel 5.21.	Perbandingan MSE dan MPE hasil peramalan harga saham penutupan bulanan DSFI, IIKP dan CPRO menggunakan metode ARIMA dengan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown .....	60

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1.	Pergerakan Return Saham Sektor Perikanan (periode: 10 Desember 2013 - 09 Desember 2014) .....	3
Gambar 2.1.	Struktur Pasar Modal Indonesia .....	15
Gambar 2.2.	Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia .....	15
Gambar 2.3.	Proses Pelaksanaan Perdagangan Saham di BEI .....	16
Gambar 2.4.	Skema Penerapan Model Box-Jenkins .....	20
Gambar 2.5.	Bagan Kerangka Pemikiran Penelitian .....	26
Gambar 4.1.	Struktur Organisasi PT. Dharma Samudera Fishing Industries, Tbk. ....	34
Gambar 4.2.	Produk PT. Dharma Samudera Fishing Industries, Tbk. ....	35
Gambar 4.3.	Struktur Organisasi PT. Inti Agro Resources, Tbk. ....	37
Gambar 4.4.	Produk PT Inti Kapuas International (shelookRED) .....	38
Gambar 4.5.	Struktur Organisasi PT. Central Proteinaprima, Tbk. ....	40
Gambar 4.6.	Produk PT. Central Proteinaprima, Tbk. ....	41
Gambar 5.1.	Data pergerakan harga saham penutupan bulanan DSFI, IIKP dan CPRO periode Oktober 2009 - September 2015 .....	42
Gambar 5.2.	Data harga saham DSFI setelah melalui 1 (satu) kali proses differencing .....	46
Gambar 5.3.	Data harga saham IIKP setelah melalui 1 (satu) kali proses differencing .....	47
Gambar 5.4.	Data harga saham CPRO setelah melalui 1 (satu) kali proses differencing .....	47
Gambar 5.5.	Grafik prediksi harga saham DFSI menggunakan model persamaan ARIMA (1,1,0) .....	56
Gambar 5.6.	Grafik prediksi harga saham IIKP menggunakan model persamaan ARIMA (3,1,2) .....	57
Gambar 5.7.	Grafik prediksi harga saham CPRO menggunakan model persamaan ARIMA (4,1,3) .....	58
Gambar 5.8.	Grafik prediksi harga saham DFSI menggunakan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown .....	59
Gambar 5.9.	Grafik prediksi harga saham IIKP menggunakan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown .....	59
Gambar 5.10.	Grafik prediksi harga saham CPRO menggunakan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown .....	59



## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1.	Harga saham penutupan bulanan DSFI, IIKP dan CPRO periode Oktober 2009 - September 2015.....	66
Lampiran 2.	Prediksi harga saham DFSI menggunakan model persamaan ARIMA (1,1,0) .....	67
Lampiran 3.	Prediksi harga saham IIKP menggunakan model persamaan ARIMA (3,1,2) .....	68
Lampiran 4.	Prediksi harga saham CPRO menggunakan model persamaan ARIMA (4,1,3) .....	69
Lampiran 5.	Prediksi harga saham DFSI menggunakan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown.....	70
Lampiran 6.	Prediksi harga saham IIKP menggunakan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown.....	71
Lampiran 7.	Prediksi harga saham CPRO menggunakan metode pemulusan eksponensial linear tunggal-Brown.....	72