

Analisis efisiensi pasar modal dengan menggunakan metode box jenkins arima

Muchammad Aulia Syafaat, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=119982&lokasi=lokal>

Abstrak

Krisis keuangan global yang disebabkan oleh Sub Prime Mortgage di Amerika telah menyebabkan harga - harga saham di dunia berjatuhan ,IHSG dan saham - saham di Indonesia juga ikut terpengaruh sehingga nilainya telah terus merosot jatuh. Pergerakan nilai IHSG dan saham ini akan dimodelkan dalam bentuk ARIMA. ARIMA sebenarnya adalah teknik untuk mencari pola yang paling cocok dari sekelompok data (curve fitting), dengan demikian ARIMA memanfaatkan sepenuhnya data masa lalu dan sekarang untuk melakukan peramalan jangka pendek yang akurat. Contoh pemakaian model ARIMA adalah peramalan harga saham dipasar modal yang dilakukan para pialang yang didasarkan pada pola perubahan harga saham dimasa lampau.

<hr><i>The Global financial crisis caused by sub prime mortgage in America has caused world stock market price declining, IHSG and Indonesian stock market also declining too cause of the global financial crisis. The movement price of IHSG and stock market will ne modeled in ARIMA. ARIMA is actually a teknik for search suitable pattern from curve fitting, so ARIMA using wholefully past and present data to forecast short term period very accurate. An example of using ARIMA model is forecasting stock price in capital market by broker based of the stock price change in past.</i>