

PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI

Dengan ini saya menyatakan bahwa skripsi yang saya tulis sebagai salah satu syarat untuk memperoleh Gelar Sarjana Ekonomi dan diajukan pada Jurusan Perbankan Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam, Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten. Ini sepenuhnya asli merupakan hasil karya tulis ilmiah saya pribadi.

Adapun tulisan maupun pendapat orang lain yang terdapat dalam skripsi ini telah saya sebutkan kutipannya secara jelas dan sesuai dengan etika keilmuan yang berlaku di bidang penulisan karya ilmiah.

Apabila dikemudian hari terbukti bahwa sebagian atau seluruh skripsi ini merupakan hasil perbuatan plagiarisme atau mencontek karya tulis orang lain, saya bersedia untuk menerima sanksi berupa pencabutan gelar kesarjanaan yang saya terima atau sanksi akademik lain sesuai dengan peraturan yang berlaku.

Serang, 14 Juli 2025



Nurkomalasari
NIM: 211420057

ABSTRAK

Nama: Nurkomalasari, NIM: 211420057, Judul Skripsi: Penerapan Metode ARIMA *Box-Jenkins* Untuk Meramalkan Harga Saham Pada PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk.

Pergerakan harga saham sangat penting, sebagai indikator utama bagi investor dalam pengambilan keputusan beli atau jual, sekaligus menjadi bahan evaluasi strategi bagi perusahaan. Oleh karena itu, penelitian ini berfokus pada pengembangan model prediksi yang mampu memperkirakan harga di periode selanjutnya, menilai potensi risiko, dan memaksimalkan keuntungan pemegang saham.

Rumusan masalah penelitian ini adalah: 1) Model ARIMA Box-Jenkins manakah yang terbaik untuk meramalkan harga saham PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk? dan 2) Berapakah hasil peramalan harga saham periode 2025 sampai dengan 2029? Dan tujuan penelitian adalah memperoleh model terbaik dan hasil peramalan tersebut.

Penelitian kuantitatif ini menggunakan 48 sampel data sekunder harga saham pembuka dari *Yahoo Finance*. Model ARIMA (2,1,1) terpilih sebagai model terbaik karena memiliki nilai kriteria informasi terendah (AIC 8,254542 dan SIC 8,412002) dan semua koefisiennya signifikan secara statistik (Probabilitas 0,0036 dan 0,0250 < 0,05). Model (2,1,1) kemudian digunakan untuk peramalan 5 tahun ke depan dengan tingkat akurasi RMSE 33,15905, MAE 31,03148, dan MAPE 48,47425. Hasil peramalan ini memberikan kontribusi praktis dalam mitigasi risiko dan perencanaan investasi, khususnya di pasar saham syariah.

Kata kunci : Peramalan, Saham, ARIMA *Box-Jenkins*



**KEMENTERIAN AGAMA REPUBLIK INDONESIA
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SULTAN MAULANA HASANUDDIN BANTEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM**

Jalan Syekh Nawawi Al-Bantani, Kel. Andamui, Kec. Curug, Kota Serang 42171

Email: surat@uinbanten.ac.id Website : www.uinbanten.ac.id

Nomor	: Nota Dinas	Kepada Yth.
Lampiran	: 1 (Satu) Eksemplar	Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN SMH BANTEN
Hal	: Usulan Munaqasyah a.n. Nurkomalasari NIM. 211420057	di – Serang

Assalamu'alaikum Wr. Wb.

Dipermaklumkan dengan hormat bahwa setelah membaca dan mengadakan perbaikan seperlunya, maka kami berpendapat bahwa Skripsi Saudarai **Nurkomalasari**, **NIM 211420057** dengan judul Skripsi **“Penerapan Metode ARIMA *Box-Jenkins* Untuk Meramalkan Harga Saham Pada PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk”** diajukan sebagai salah satu syarat untuk melengkapi Ujian Munaqasyah pada Jurusan Perbankan Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Sultan Maulana Hasanuddin Banten. Maka kami ajukan skripsi ini dengan harapan dapat segera dimunaqasyahkan.

Demikian, atas perhatian Bapak/Ibu, kami ucapkan terima kasih.

Wassalamu'alaikum Wr. Wb.

Serang, 14 Juli 2025

Pembimbing I

Prof. Dr. H. Itang, M.Ag.
NIP. 197108041998031003

Pembimbing II

Irmatul Hasanah, M.Si.
NIP: 199108302019032021

PERSETUJUAN

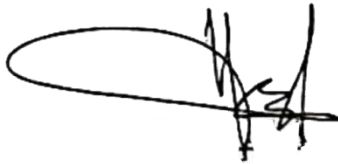
**PENERAPAN METODE ARIMA *BOX-JENKINS* UNTUK
MERAMALKAN HARGA SAHAM PADA PT. BANK PANIN DUBAI
SYARIAH TBK**

Oleh:

Nurkomalasari
NIM: 211420057

Menyetujui,

Pembimbing I,



Prof. Dr. H. Itang, M.Ag.
NIP. 197108041998031003

Pembimbing II,



Irmatul Hasanah, M.Si.
NIP: 199108302019032021

Mengetahui,

Dekan

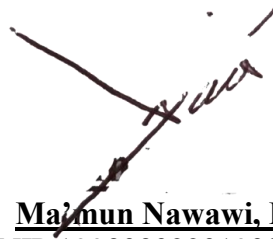
Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam



Prof. Dr. Budi Sudrajat, M.A
NIP: 197403072002121004

Ketua Jurusan

Perbankan Syariah



Maimun Nawawi, M.E
NIP.199303022019031009

PENGESAHAN

Skripsi a.n Nurkomalasari NIM: 211420057 yang berjudul: **“Penerapan Metode Arima *Box-Jenkins* Untuk Meramalkan Harga Saham Pada PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk”**, telah diujikan dalam sidang Munaqasyah Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten pada tanggal **29 September 2025**, skripsi ini telah diterima sebagai salah satu syarat untuk memperoleh Gelar Sarjana Program Strata satu (S1) pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam Jurusan Perbankan Syariah Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten.

Serang, 29 September 2025

Sidang Munaqasyah

Ketua Merangkap Anggota



Dr. H. Efi Syarifudin, M.M
NIP: 197803142005011005

Sekretaris Merangkap Anggota



Yani Aguspriyani, M.E
NIP: 198908222019032009

Anggota-Anggota

Penguji I



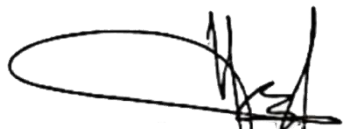
Dr. Zaini Ibrahim, M.Si
NIP: 197801132006041002

Penguji II



Najmi Hillalliyati, M.Pd
NIP: 199004052020122009

Pembimbing I



Prof. Dr. H. Itank, M.Ag.
NIP. 197108041998031003

Pembimbing II



Irmatul Hasanah, M.Si.
NIP: 199108302019032021

PERSEMBAHAN

Bismillahirrahmanirrahim,

Dengan nama Allah yang Maha Pengasih dan Maha Penyayang. Rasa syukur kepada Allah yang telah memberikan nikmat yang luar biasa, sehingga penulis bisa menyelesaikan tugas akhirnya. Karya ini penulis persembahkan untuk orang-orang tercinta yang penuh kasih sayang dan semangat mendukung dan mendoakan disetiap langkah penulis. Mereka adalah orang tuaku tercinta

(Bpk. Nawawi dan Ibu Jirah)

Orang yang senantiasa mendoakan dan memberikan dukungan sepenuh hati kepada anaknya untuk meraih impian besar, dengan kasih sayang yang tulus serta pengorbanan yang tiada henti kepada penulis. Kepada nenekku yang tersayang

(Ibu Darinah)

terima kasih telah menjadi sumber cinta dan ketenangan dalam hidupku doa-doamu selalu menjadi kekuatan yang terasa begitu nyata. Tanpa doa, dukungan, dan kasih sayang kalian, aku tak akan berada di titik ini. Semoga Allah SWT selalu memberikan berkah, kesehatan, dan kebahagiaan untuk kalian semua. Karya ini adalah wujud dari cinta yang selalu kalian berikan dalam setiap langkahku.

MOTTO

يَا أَيُّهَا الَّذِينَ آمَنُوا اتَّقُوا اللَّهَ وَلْتَنْظُرْ نَفْسٌ مَّا قَدَّمتْ لِعَدِّ وَاتَّقُوا اللَّهَ إِنَّ اللَّهَ حَبِيرٌ بِمَا تَعْمَلُونَ

“Wahai orang-orang yang beriman, bertakwalah kepada Allah dan hendaklah setiap orang memperhatikan apa yang telah diperbuatnya untuk hari esok (akhirat). Bertakwalah kepada Allah. Sesungguhnya Allah Maha teliti terhadap apa yang kamu kerjakan.”

(Q.S Al-Hasyr Ayat 18)

RIWAYAT HIDUP

Penulis dilahirkan di Serang pada 10 April 2004, yang kemudian diberi nama Nurkomalasari oleh kedua orang tua penulis. Penulis merupakan putri satu-satunya dari pasangan Ibu Jirah Nurul Darliah dan Bapak Nawawi. Alamat Kampung Cailat Desa Teras Kecamatan Careng Kabupaten Serang, Banten.

Pendidikan formal yang ditempuh penulis yaitu pada tingkat sekolah dasar di SDN Teras 2 lulus pada tahun 2015, kemudian melanjutkan ke SMP Al-Mukhtariah lulus pada tahun 2018, dan SMA Al-Mukhtariah lulus pada tahun 2021. Setelah itu penulis melanjutkan ke Perguruan Tinggi Agama Islam Negeri, tepatnya di Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam Jurusan Perbankan Syariah.

Selain masa perkuliahan, penulis aktif berorganisasi di kegiatan Internal kampus Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten, yaitu Himpunan Mahasiswa Jurusan Perbankan Syariah periode 2022 sampai 2023.

KATA PENGANTAR

Assalamu''alaikum Wr.Wb.

Ungkapan Puji syukur khadirat Allah SWT, atas karunia dan rahmatnya bagi kita kaum muslimin masih diberikan nikmat sehat wal'afiat. Shalawat serta salam tercurahkan kepada Nabi Besar Muhammad SAW, yang merupakan suri tauladan bagi umat islam hingga akhir zaman.

Alhamdulillah dengan kemudahan yang diberikan oleh Allah SWT dan dengan usaha yang sungguh-sungguh akhirnya penulis dapat menyelesaikan Skripsi yang berjudul ***“Penerapan Metode ARIMA Box-Jenkins Untuk Meramalkan Harga Saham Pada PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk”***.

Oleh karena itu penulis mengucapkan banyak terimakasih kepada berbagai pihak yang telah membantu penyusunan skripsi ini, diantaranya:

1. Prof. Dr. H. Muhammad Ishom, S.Ag., M.A., Rektor Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten, yang telah memberikan kesempatan kepada penulis untuk bergabung dan belajar dilingkungan UIN SMH Banten.
2. Prof. Dr. Budi Sudrajat, M.A., Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Sultan Maulana Hasanuddin Banten yang telah mendorong untuk dapat menyelesaikan skripsi ini.
3. Ma'mun Nawawi, M.E., Ketua Jurusan Perbankan Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam.
4. Prof. Dr. H. Itang, M.Ag., selaku pembimbing I dan Ibu Irmatul Hasanah, M.Si., selaku pembimbing II yang telah membimbing,

memberi saran-saran dan motivasi dalam penyusunan skripsi ini sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini.

5. Bapak/Ibu Seluruh Dosen, staff dan pegawai Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam, yang telah membantu baik secara langsung maupun tidak dalam proses penyusunan skripsi ini.
6. Terima kasih yang sebesar-besarnya kepada kedua orangtuaku tercinta, karena telah menjadi sumber kekuatan, doa, dan semangat dalam setiap langkah yang saya tempuh. Abah, mama, kalian tak pernah lelah mendukung dan mendoakan aku, bahkan saat aku sendiri mulai merasa lelah. Kalian selalu hadir dalam diam dengan doa, dalam lelah dengan ketulusan, dan dalam kesederhanaan dengan cinta yang tak ternilai. Terima kasih karena telah mengusahakan pendidikan saya tanpa mengenal kata menyerah. Semoga Allah selalu menjaga kalian dalam kasih sayang dan kesehatan, dan semoga kelak aku bisa membalas walau hanya sedikit dari segala kebaikan yang telah kalian berikan.
7. Untuk sahabatku Intan dan Nabila, Kehadiran kalian selalu jadi tempatku berbagi rasa dan semangat. Dukungan dan doa kalian sangat berarti dalam perjalanan ini.
8. Untuk Vava, Lianah, Caca, dan Fani Terima kasih atas kebersamaan kalian selama ini. Kalian jadi penyemangat di tengah lelah dan tawa. Terkhusus Fani, terima kasih sudah jadi partner terbaik di akhir semester menemani, mendukung, dan saling menguatkan hingga titik akhir.
9. Kepada Elin, Luvita, dan Hilda. Elin, terima kasih sudah jadi teman dekat sejak awal kuliah selalu hadir di setiap suka dan duka. Untuk Luvita dan Hilda, terima kasih atas kebersamaan dan dukungan

kalian. Kalian bukan sekadar teman, tapi bagian penting yang banyak memberi semangat dan pengaruh besar dalam proses ini.

10. Terima kasih Asmara Gen Z yang jadi hiburan andalan di tengah penatnya menyusun skripsi. Ceritanya yang seru dan penuh kejutan selalu berhasil mengangkat mood dan mengembalikan semangat. Tontonan sederhana yang ternyata punya peran besar dalam perjalanan ini.
11. Saya mengucapkan terima kasih yang sebesar-besarnya kepada teman-teman seperjuangan, baik di dalam maupun di luar kampus, yang telah menjadi bagian dari proses panjang penyusunan skripsi ini. Terima kasih atas semangat, dukungan, candaan, serta kebersamaan yang telah menjadi penyemangat di tengah kelelahan dan tekanan.
12. Terakhir untuk diriku, Nurkomalasari seorang perempuan sederhana berkeinginan tinggi yang terkadang sulit dipahami. Anak berusia 21 tahun ini, walau keras kepala, sering juga bersikap seperti anak kecil. Terima kasih atas segala perjuangan, kesabaran, dan ketekunanmu di setiap langkah penuh tantangan. Kamu hebat, aku bangga kamu bisa menyelesaikan perjalanan panjang ini, meski air mata dan kegelisahan sering datang. Kamu terus maju meski jalan terasa berat. Terima kasih sudah hadir di dunia dan bertahan sejauh ini, melewati banyak rintangan. Terima kasih telah berusaha keras meyakinkan dan menguatkan diri sendiri untuk menyelesaikan studi ini. Berbahagialah selalu di mana pun kamu berada, rayakan kehadiranmu, dan bersinarlah di mana pun kamu memijakkan kaki. Aku yakin, dengan usaha dan doamu, Allah telah merencanakan yang terbaik. Semoga langkah kebaikan selalu bersamamu, dan semoga Allah senantiasa meridhoi serta melindungimu. Aamiin.

Mengingat penulis masih dalam tahap belajar maka untuk itu penulis mohon maaf jika dalam penulisan skripsi ini masih terdapat banyak kekurangan, sehingga penulis sangat membutuhkan kritik dan saran yang membangun. Semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi penulis khususnya dan bagi pembaca umumnya.

Wassalamu'alaikum Wr.Wb

Serang, 14 Juli 2025

Penulis,

Nurkomalasari

NIM: 211420057

DAFTAR ISI

PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	i
ABSTRAK	ii
NOTA DINAS	iii
PERSETUJUAN	iv
PENGESAHAN.....	v
PERSEMBAHAN	vi
MOTO.....	vii
RIWAYAT HIDUP	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xiii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR GRAFIK	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	10
C. Batasan Masalah	11
D. Perumusan Masalah	11
E. Tujuan Penelitian	11
F. Manfaat Penelitian	12
G. Sistematika Pembahasan	13
BAB II KAJIAN PUSTAKA	14
A. Landasan Teori	14
B. Saham.....	14
C. Peramalan (<i>Forecasting</i>)	21

D. ARIMA <i>Box-Jenkins</i>	25
E. Penelitian Terdahulu Yang Relevan	27
F. Kerangka Pemikiran.....	34
G. Hipotesis.....	36
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	37
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	37
B. Populasi dan Sampel	37
C. Jenis Metode Penelitian	39
D. Teknik Pengumpulan Data	40
E. Teknik Analisis Data	40
BAB IV PEMBAHASAN HASIL PENELITIAN	45
A. Gambaran Umum Objek Penelitian	45
B. Deskripsi Data Penelitian.....	50
C. Hasil Analisis Dan Penelitian.....	50
D. Pembahasan Penelitian.....	67
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	69
A. Kesimpulan	69
B. Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA	71
LAMPIRAN.....	76

DAFTAR TABEL

Tabel 3. 1 Data Harga Saham Pembuka PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk.....	38
Tabel 4. 1 Hasil Model yang diperoleh.....	63
Tabel 4. 2 Verifikasi Model ARIMA menggunakan nilai AIC dan SIC.....	63
Tabel 4. 3 Hasil Peramalan 2025-2029.....	66

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2. 1 Kerangka Pemikiran.....	35
Gambar 4. 2 Output Plot ACF Dan PACF tingkat Level	52
Gambar 4. 3 Output Uji ADF Tingkat Level	53
Gambar 4. 5 Plot Acf Dan Pacf Setelah First Differencing	56
Gambar 4. 6 Uji ADF Setelah First Differencing	57
Gambar 4. 7 Output Analisis Model ARIMA (1,1,1).....	59
Gambar 4. 8 Output Analisis Model ARIMA (1,1,2).....	60
Gambar 4. 9 Output Analisis Model ARIMA (2,1,1).....	61
Gambar 4. 10 Output Analisis Model ARIMA (2,1,2).....	62
Gambar 4. 11 Output Hasil Diagnosa <i>Q-Statistik</i> ARIMA (2,1,1)	64
Gambar 4. 12 Output Forecasting.....	65

DAFTAR GRAFIK

Grafik 1. 1 Pergerakan Harga Saham Pembuka PT. Bank Panin Dubai Syariah Tbk Tahun 2021-2024	5
Grafik 4. 1 Plot Data <i>Time Series</i> Tingkat Level.....	51
Grafik 4. 2 Plot Data Setelah First Differencing.....	55