

**PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERTAMBANGAN DI  
*JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)* UNTUK MEMBANTU  
*TRADER* MENGAMBIL KEPUTUSAN PEMBELIAN  
SAHAM MENGGUNAKAN METODE ARIMA**

**SKRIPSI**

**OLEH  
AUNI LADUNNIYAH**



**UNIVERSITAS ISLAM NEGERI ANTASARI  
BANJARMASIN  
2023 M/1444 H**

**PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR PERTAMBANGAN DI  
JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) UNTUK MEMBANTU  
TRADER MENGAMBIL KEPUTUSAN PEMBELIAN  
SAHAM MENGGUNAKAN METODE ARIMA**

**SKRIPSI**

**Diajukan kepada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam  
untuk Memenuhi Sebagian Syarat  
Guna Mencapai Gelar Sarjana  
dalam Ilmu Ekonomi**

**Oleh :**

**Auni Ladunniyah**

**190105010059**

**UNIVERSITAS ISLAM NEGERI ANTASARI  
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM  
JURUSAN EKONOMI SYARIAH  
BANJARMASIN  
2023 M/1444 H**

## PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN

### PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama : Auni Ladunniyah  
NIM : 190105010059  
Tempat/Tgl. Lahir : Karang Mulya, 12 Agustus 2001  
Jurusan : Ekonomi Syariah  
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari  
Banjarmasin

Menyatakan dengan sebenarnya bahwa skripsi yang saya tulis ini benar-benar merupakan karya saya sendiri, bukan merupakan pengambilalihan tulisan atau pikiran orang lain yang saya akui sebagai tulisan atau pikiran saya sendiri. Jika di kemudian hari terbukti ia merupakan duplikat, tiruan, plagiat atau dibuat oleh orang lain secara keseluruhan atau sebagian besar, maka skripsi dan gelar yang diperoleh karenanya batal demi hukum.

Banjarmasin, 09 Juni 2023

Yang membuat pernyataan,

Tanda tangan



Auni Ladunniyah

## PERSETUJUAN

### PERSETUJUAN

Skripsi yang berjudul : *Prediksi Harga Saham Sektor Pertambangan di Jakarta Islamic Index (JII) untuk Membantu Trader Mengambil Keputusan Pembelian Saham*

Ditulis oleh : Auni Ladunniyah  
N I M : 190105010059  
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis Islam  
Program : Strata Satu (S-1)  
Program Studi : Ekonomi Syariah  
Tahun Akademik : 2023/2024  
Tempat dan tanggal lahir : Karang Mulya, 12 Agustus 2001  
Alamat : Karang Intan, Kec. Kuranji, Kab. Tanah Bumbu, Kalimantan Selatan


Setelah diteliti dan diadakan perbaikan seperlunya, kami dapat menyetujuinya untuk dipertahankan di depan Sidang Tim Penguji Skripsi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari Banjarmasin.

Mengetahui,  
Ketua Program Studi Ekonomi Syariah  
Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam  
UIN Antasari Banjarmasin,

Banjarmasin, 05. Juni ..... 2023  
Pembimbing



Rohana Faridah, S.E., M.M.  
NIP. 197804272009012010



Prof. Dr. H. Fakhurrahman Azhari, M.H.I  
NIP. 196006091988031003

## PENGESAHAN

### PENGESAHAN

Skripsi yang berjudul "Prediksi Harga Saham Sektor Pertambangan di Jakarta *Islamic Index* (JII) untuk Membantu *Trader* Mengambil Keputusan Pembelian Saham Menggunakan Metode ARIMA", ditulis oleh Auni Ladunniyah, telah diujikan dalam Sidang Tim Penguji Skripsi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari Banjarmasin pada:

Hari : Selasa

Tanggal : 18 Juli 2023





Dinyatakan LULUS dengan predikat: A



Dekan Fakultas Ekonomi dan  
Bisnis Islam  
UIN Antasari Banjarmasin

Dr. H. Sukarni, M. Ag  
NIP. 196304171991021001

### Tim Penguji

Nama	Tanda Tangan
1. Prof. Dr. H. Akh. Fauzi Aseri, MA. I. (Ketua)	
2. H. Abdul Gafur, Lc, MA. (Anggota)	2. 
3. Dr. Ilham Akbar, S. H. M. Kn. (Anggota)	3. 
4. Muhammad Noval, S. E. I, M. Si (Anggota)	4. 

## ABSTRAK

**AUNI LADUNNIYAH.** 2023. *Prediksi Harga Saham Sektor Pertambangan di Jakarta Islamic Index (JII) untuk Membantu Trader Mengambil Keputusan Pembelian Saham Menggunakan Metode ARIMA.* Skripsi, Program Studi Ekonomi Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam. Pembimbing: Prof. Dr. H. Fathurrahman Azhari, M. H. I.

**Kata Kunci:** Batubara, Metode ARIMA, *Forecasting*

Batubara menjadi sumber daya mineral terbesar di Indonesia yakni mencapai 110 miliar ton serta memiliki cadangan sebesar 36 miliar ton hingga akhir 2021. Hasil pertambangan yang banyak digunakan sebagai sumber energi untuk kegiatan operasional, khususnya di sektor industri diberbagai negara salah satunya adalah batubara. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui prediksi harga saham pertambangan khususnya batubara yang ada di *Jakarta Islamic Index (JII)* dengan menggunakan metode ARIMA dalam memprediksi harga saham tersebut. Hasil dari penelitian ini diharapkan mampu menjadi referensi bagi para trader dalam mengambil keputusan jual-beli saham batubara PT. Adaro Energy, Tbk dan PT. Bukit Asam, Tbk.

Penelitian ini menggunakan jenis penelitian kuantitatif dengan metode deskriptif kuantitatif. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder berupa harga perutupan saham harian pada periode 2 Februari 2022-28 Februari 2023 untuk memprediksi harga saham selama 20 hari kedepan dimulai pada 1 Maret – 31 Maret 2023. Metode analisis data yang digunakan untuk memprediksi harga saham pada penelitian ini adalah menggunakan metode ARIMA.

Berdasarkan hasil penelitian diperoleh Model prediksi terbaik dengan menggunakan metode ARIMA berdasarkan beberapa uji yang telah dilakukan pada perusahaan PT. Adaro Energy, Tbk (ADRO) adalah model ARIMA (0,1,1), dan pada perusahaan PT. Bukit Asam, Tbk (PTBA) adalah model ARIMA (1,1,1). Hasil prediksi harga saham untuk 20 hari kedepan pada dua perusahaan tersebut mengalami kenaikan secara perlahan yang memberikan hasil harga prediksi mendekati dengan harga aktual.

## MOTTO

مَا وَدَّعَكَ رَبُّكَ وَمَا قَلَىٰ

“Tuhanmu tidak meninggalkan dan tidak (pula) membencimu.”

“Rencana Allah padamu lebih baik dari rencanamu. Terkadang Allah menghalangi rencanamu untuk menguji kesabaranmu,. Maka perhatikanlah kepada-Nya kesabaran yang indah. Tak lama kamu akan melihat sesuatu yang menggembirakanmu.”  
(Shaidul Khathir 1/205)

## **PERSEMBAHAN**

Kupersembahkan dengan segenap cinta dan doa  
Karya yang sederhana ini untuk:

*Diriku,*

*Terima kasih sudah bertahan sampai titik ini*

*Kedua Orang Tua Ku Tercinta*

**Bapak Musta'an dan Ibu Sri Wahyuni**

*Kedua Adikku*

**Nazra Ramadhani dan Ainun Nahdhati**

*Seluruh Keluarga dan Teman-teman Ku*

Tanpa doa, semangat dan kasih sayang  
Yang tulus, sulit untuk sampai pada titik ini  
Terima kasih.



## PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-INDONESIA

Transliterasi kata Arab ke dalam huruf Latin dalam skripsi ini berpedoman pada Surat Keputusan Bersama Menteri Agama dan Menteri Pendidikan dan Kebudayaan Republik Indonesia Tanggal 22 Januari 1988 Nomor 157/1987 dan 0593/1987.

### I. Konsonan tunggal

Huruf Arab	Nama	Huruf Latin	Nama
ا	alif	tidak dilambangkan	tidak dilambangkan
ب	ba	B	Be
ت	ta'	T	Te
ث	s\`a'	s\	es (dengan titik di atas)
ج	jim	J	Je
ح	h}a'	h}	ha (dengan titik di bawah)
خ	kha'	Kh	ka dan ha
د	dal	D	De
ذ	z\`al	z\	zet (dengan titik di atas)
ر	ra'	R	Er
ز	zai	Z	Zet
س	sin	S	Es
ش	syin	Sy	es dan ye
ص	s}ad	s}	es (dengan titik di bawah)
ض	d}ad}	d}	de (dengan titik di bawah)
ط	t}a'	t}	te (dengan titik di bawah)
ظ	z}a'	z}	zet (dengan titik di bawah)
ع	'ain	'	koma terbalik di atas
غ	gain	G	Ge

ف	fa'	F	Ef
ق	qaf	Q	Qi
ك	kaf	K	Ka
ل	lam	L	'el
م	mim	M	'em
ن	nun	N	'en
و	waw	W	We
ه	ha'	H	Ha
ء	hamzah	`	Apostrof
ي	ya'	Y	Ye

## II. Konsonan rangkap karena syaddah ditulis rangkap

متكبر	Ditulis	<i>Mutakabbir</i>
القدوس	Ditulis	<i>al-qudu&gt;s</i>

## III. Ta' marbutah di akhir kata

- a. Bila dimatikan ditulis *h*

جامعة	Ditulis	<i>ja&gt;mi'ah</i>
مكتبة	Ditulis	<i>Maktabah</i>



(ketentuan ini tidak diperlukan untuk kata-kata Arab yang sudah terserap dalam bahasa Indonesia, seperti salat, surat, ayat, zakat dan zebagainya, kecuali bila dikehendaki lafal aslinya).

- b. Bila diikuti dengan kata sandang 'al' serta bacaan kedua terpisah, maka ditulis dengan *h*

المكتبة الجميلة	Ditulis	<i>al-maktabah al-jami&gt;lah</i>
-----------------	---------	-----------------------------------

## IV. Vokal pendek

◌َ	Fathah	ditulis	A
----	--------	---------	---

	Kasrah	ditulis	I
	Dammah	ditulis	U
شكر	Fathah	ditulis	Syakara
قرأ	Kasrah	ditulis	quri'a
ينطق	Dammah	ditulis	yant}iqu

### V. Vokal panjang

1	fathah + alif كاملة	Ditulis Ditulis	<i>a&gt;</i> <i>ka&gt;milah</i>
2	fathah + ya mati صلى	Ditulis Ditulis	<i>a&gt;</i> <i>s}alla&gt;</i>
3	kasrah + ya mati شديد	Ditulis Ditulis	<i>i&gt;</i> <i>syadi&gt;d</i>
4	dammah + wawu mati صدر	Ditulis Ditulis	<i>u&gt;</i> <i>s}udu&gt;r</i>

### VI. Vokal rangkap

1	fathah + ya mati رويد	Ditulis Ditulis	ai <i>ruwaidun</i>
2	fathah + wawu mati وفرعون ذي الأوتاد	Ditulis Ditulis	au <i>wa fir'auna z}i al-auta&gt;d</i>

### VII. Vokal pendek yang berurutan dalam satu kata dipisahkan dengan apostrof

أنتم أشد خلقا	Ditulis	<i>a'antum asyaddu khalqan</i>
---------------	---------	--------------------------------

### VIII. Kata sandang alif+lām

a. Bila diikuti huruf *Qamariyyah*

القران	Ditulis	<i>al-Qur'a&gt;n</i>
الكتاب	Ditulis	<i>al-kita&gt;b</i>

b. Bila diikuti huruf *Syamsiyyah* ditulis dengan *diidgamkan*

الصبح	Ditulis	<i>as}-s}ubh}u</i>
الساهرة	Ditulis	<i>as-sa&gt;hirah</i>

### IX. Penulisan Kata-Kata Dalam Rangkaian Kalimat

Ditulis menurut bunyi atau pengucapannya dengan menulis penulisannya

بر الوالدين	Ditulis	<i>birru al-wa&gt;lidaini</i>
إذا الشمس	Ditulis	<i>Iz\ a asy-syamsu</i>

## KATA PENGANTAR

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

Segala puji hanyalah bagi Allah Swt., atas segala limpahan karunia, nikmat, dan petunjuk-Nya sehingga pada akhirnya skripsi ini dapat terselesaikan. Shalawat serta salam selalu kita haturkan kepada panutan Nabi Besar Muhammad Saw., keluarga, sahabat, dan para pengikut beliau hingga akhir zaman. Lepas dari khilaf dan segala kekurangan, penulis merasa sangat bersyukur telah menyelesaikan skripsi yang berjudul “Prediksi Harga Saham Sektor Pertambangan di Jakarta *Islamic Index* (JII) Untuk Membantu Trader Mengambil Keputusan Pembelian Saham Menggunakan Metode ARIMA”, sebagai salah satu syarat guna memperoleh gelar strata satu Sarjana Ekonomi, pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari Banjarmasin.

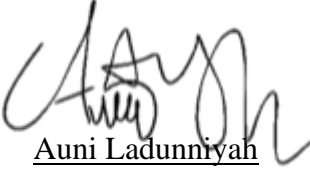
Penulis menyadari sepenuhnya, telah banyak mendapatkan dukungan, bimbingan dan dorongan dari berbagai pihak yang telah menyumbangkan pikiran, waktu, tenaga dan sebagainya. Oleh karena itu, pada kesempatan ini dengan setulus hatu penulis mengucapkan terima kasih kepada:

1. Dr. H. Sukarni, M.Ag., selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari Banjarmasin.
2. Rohana Faridah, S.E, M.M dan Muhammad Qomarrudin, M.E., selaku ketua dan sekretaris program studi Ekonomi Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari Banjarmasin.
3. Prof. Dr. H, Fathurrahman Azhari, M. HI, selaku Penasehat Akademik sekaligus Pembimbing Skripsi yang telah memberikan saran, bimbingan, serta meluangkan waktunya kepada penulis selama masa studi dan proses penyelesaian skripsi.
4. Bapak dan Ibu Dosen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Antasari Banjarmasin yang telah memberikan bekal ilmu yang bermanfaat bagi penulis.
5. Bapak dan Ibu Tenaga Kependidikan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam.

Semoga Allah Swt., membalas segala bentuk kebaikan pihak-pihak yang terkait. Akhir kata penulis mengharapkan ampunan dan ridha Allah Swt., semoga karya tulis ini dapat memberikan manfaat bagi semua pihak dan menambah khazanah pengetahuan ekonomi dan bisnis Islam, Amin.

Banjarmasin, 09 Juni 2023

Penulis,



Auni Ladunniyah

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN .....</b>	<b>ii</b>
<b>PERSETUJUAN.....</b>	<b>iii</b>
<b>PENGESAHAN .....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>v</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>vi</b>
<b>PERSEMBAHAN.....</b>	<b>vii</b>
<b>PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-INDONESIA .....</b>	<b>viii</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xvi</b>
<b>DAFTAR GRAFIK .....</b>	<b>xvii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xvi</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah .....	11
C. Tujuan Penelitian.....	11
D. Kegunaan Penelitian.....	11
E. Definisi Operasional.....	12
F. Penelitian Terdahulu .....	17
G. Kerangka Berfikir .....	22
H. Metode Penelitian.....	22
I. Sistematika Penulisan.....	23
<b>BAB II TEORI PREDIKSI HARGA SAHAM .....</b>	<b>25</b>
A. Teori Dow .....	25
B. Analisis Saham .....	27
C. <i>Forecasting</i> .....	30
D. <i>Time Series</i> .....	34

E. Metode ARIMA .....	36
F. Estimasi Parameter .....	38
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>42</b>
A. Jenis dan Pendekatan Penelitian .....	42
B. Populasi dan Sampel .....	42
C. Data dan Sumber Data .....	45
D. Metode Pengumpulan Data .....	46
E. Teknik Pengolahan Data .....	47
F. Analisis Data .....	48
<b>BAB IV LAPORAN PENELITIAN DAN ANALISIS DATA .....</b>	<b>50</b>
A. Penyajian Data .....	50
B. Hasil Pengujian Data .....	57
C. Analisis Data .....	74
<b>BAB V PENUTUP .....</b>	<b>80</b>
A. Simpulan .....	80
B. Saran-saran .....	81
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>82</b>



## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Populasi Penelitian .....	43
Tabel 3.2 Perusahaan Sektor Pertambangan .....	43
Tabel 3.3 Sampel Penelitian.....	44
Tabel 3.4 Tata Cara Pemilihan Sampel.....	47
Tabel 4.1 Daftar Sampel Perusahaan Batubara JII.....	51
Tabel 4.2 Hasil Uji Stasioner .....	58
Tabel 4.3 Hasil Identifikasi Plot ACF dan PACF .....	61
Tabel 4.4 Estimasi Model Tentatif PT. Adaro Energy, Tbk .....	63
Tabel 4.5 Estimasi Model Tentatif PT. Bukit Asam, Tbk .....	63
Tabel 4.6 Hasil Pengujian <i>White Noise</i> .....	67
Tabel 4.7 Kriteria Nilai MAPE .....	69
Tabel 4.8 Hasil Uji Nilai MAPE.....	69
Tabel 4.9 Harga Prediksi dan Aktual PT. Adaro Energy, Tbk .....	70
Tabel 4.10 Harga Prediksi dan Aktual PT. Bukit Asam, Tbk.....	72

## DAFTAR GRAFIK

Grafik 1.1 Return Rata-rata Saham.....	7
Grafik 4.1 Pergerakan harga Saham PT. Adaro Energy, Tbk .....	56
Grafik 4.2 Pergerakan harga Saham PT. Bukit Asam, Tbk .....	56
Grafik 4.3 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi PT. Adaro Energy, Tbk ....	70
Grafik 4.4 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi PT. Bukit Asam, Tbk .....	72

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Kerangka Berfikir.....	22
Gambar 2.1 Pola Horizontal.....	32
Gambar 2.2 Pola Siklus.....	33
Gambar 2.3 Pola Musiman.....	33
Gambar 2.4 pola Trend .....	34
Gambar 4.1 Logo PT. Adaro Energy, Tbk.....	51
Gambar 4.2 Logo PT. Bukit Asam, Tbk .....	53
Gambar 4.3 Plot ACF dan PACF PT. Adaro Energy, Tbk .....	60
Gambar 4.4 Plot ACF san PACF PT. Bukit Asam, Tbk .....	61
Gambar 4.5 Uji Identifikasi Plot ACF dan PACF PT. Adaro Energy, Tbk.....	65
Gambar 5.6 Uji Identifikasi Plot ACF dan PACF PT. Bukit Asam, Tbk.....	66