

ABSTRAK

Harga kini (P_t) penting untuk diperkirakan guna membantu pengambilan keputusan investasi finansial bagi *investor* dan *trader*, membantu dalam penyusunan informasi keuangan dan penyajian rasio-rasio keuangan dalam laporan keuangan bagi profesi akuntan, membantu dalam pemberian pandangan bagi kelangsungan bisnis (*going concern*) *auditee* dan penilaian atas kinerja *auditee* dalam penyajian laporan auditor independen dan laporan evaluasi kinerja bagi profesi auditor. Penelitian ini menggunakan metode analisis teknikal *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA) untuk melakukan *forecasting* dan analisis harga kini, dan merupakan jenis penelitian deskriptif prediktif dengan data sekunder kuantitatif, yakni harga saham penutupan harian disesuaikan selama tahun 2011 dari saham-saham *bluechip* tahun 2012 yang terdaftar pada indeks LQ 45 Bursa Efek Indonesia tahun 2008-2012. Model ARIMA untuk saham BMRI adalah ARIMA (25,1,25), untuk saham BBCA adalah ARIMA (3,1,8), untuk saham ASII adalah ARIMA (25,1,25), untuk saham INDF adalah ARIMA (22,1,22), untuk saham AALI adalah ARIMA (15,1,36), untuk saham PGAS adalah ARIMA (34,1,34), untuk saham ANTM adalah ARIMA (4,1,34) dan untuk saham INCO adalah ARIMA (17,1,36). Periode peramalan adalah 1 Januari 2012 hingga 31 Januari 2012 dan memberikan nilai kesalahan yang berkisar antara 2.4696539% hingga 14.19859%. Dengan demikian metode ARIMA dapat digunakan sebagai metode peramalan yang baik.

Kata kunci: Saham, Analisis Teknikal, ARIMA, LQ 45, Peramalan, *Bluechip*

ABSTRACT

Present price (P_t) is necessary to be forecasted in order to help investor and trader to take financial investment decision, to help accountant for the making of financial information and the presentation of financial ratios, and to help auditor in giving views of client's business continuity and appraising client's business. This study uses Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) technical analysis method to forecast and analyze the present price, and is the type of descriptive predictive research, and is using secondary and quantitative data (daily closing-adjusted stock price during 2011 as its data), and pointing at bluechip stocks on 2012 that have been listed on LQ 45 index, Indonesia Stock Exchange since 2008-2012. ARIMA's models for BMRI is ARIMA (25,1,25), for BBCA is ARIMA (3,1,8), for ASII is ARIMA (25,1,25), for INDF is ARIMA (22,1,22), for AALI is ARIMA (15,1,36), for PGAS is ARIMA (34,1,34), for ANTM is ARIMA (4,1,34) and for INCO is ARIMA (17,1,36). Its forecasting period is a month (January, 1st 2012 – January, 31st 2012) and resulting on 2.4696539% - 14.19859% values in error. Thus, ARIMA can be used as a good forecasting method.

Keywords: Stocks, Technical Analysis, ARIMA, LQ 45, Forecast, Bluechip