

## BAB V

### PENUTUP

#### 5.1 Kesimpulan

Berdasarkan uraian pengolahan data yang telah dilakukan sebelumnya, maka dapat disimpulkan sebagai berikut.

1. Model ARFIMA terbaik yang diperoleh untuk memodelkan harga saham PT. ANTAM Tbk adalah ARFIMA (1;0,3930;2) yang dapat ditampilkan sebagai berikut.

$$(1 - 0,8927B)(1 - B)^{0,3930} X_t = (1 - 0,1589B - 0,2270B^2)\varepsilon_t,$$

Pemodelan data harga saham PT. ANTAM Tbk dengan menggunakan model ARFIMA(1;0,3930;2) memperoleh nilai MAPE = 2,0970%. Dengan nilai MAPE < 10%, dapat dikatakan bahwa hasil pemodelan model ARFIMA (1;0,3930;2) sangat baik.

2. Peramalan data harga saham PT. ANTAM Tbk dengan menggunakan model ARFIMA(1;0,3930;2) memberikan nilai MAPE = 3,1070%. Dengan nilai MAPE < 10%, dapat dikatakan bahwa hasil peramalan model ARFIMA (1;0,3930;2) sangat baik.

## 5.2 Saran

Dari hasil penelitian ini, maka penulis memberi saran kepada peneliti selanjutnya untuk dapat mengembangkan penelitian ini menggunakan beberapa model seperti model ARFIMAX, hybrid ARFIMA dengan model fuzzy time series, dan *Long Short Term Memory*(LSTM) pada data deret waktu yang berpola *long memory*.

