



ANALISIS PERGERAKAN INDEX IDX-30 MENGGUNAKAN METODE
AUTO REGRESIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE
(ARIMA) SAAT DAN SETELAH PANDEMI COVID 19

**TUGAS AKHIR
SKRIPSI**

ACHMAD ILHAM FAUZAN
43122010336

PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MERCU BUANA
JAKARTA
2026



ANALISIS PERGERAKAN INDEX IDX-30 MENGGUNAKAN METODE
AUTO REGRESIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE
(ARIMA) SAAT DAN SETELAH PANDEMI COVID 19

**TUGAS AKHIR
SKRIPSI**

**Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar
Sarjana**

ACHMAD ILHAM FAUZAN

43122010336

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MERCU BUANA
JAKARTA**

2026

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI

Yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : Achmad Ilham Fauzan
Nim : 43122010336
Program Studi : S1 Manajemen

Menyatakan bahwa skripsi ini adalah murni hasil karya sendiri apabila saya mengutip dari hasil karya orang lain, maka saya mencantumkan sumbernya sesuai dengan ketentuan yang berlaku. Saya bersedia dikenai sanksi pembatalan skripsi ini apabila terbukti melakukan tindakan plagiat (penjiplakan).

Demikianlah pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Jakarta, 7 Juni 2026



Achmad Ilham Fauzan

43122010336

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

	BIRO PERPUSTAKAAN UNIVERSITAS MERCU BUANA	
---	--	---

No.Dokumen	1-1-3.4.11.00	Distribusi					
Tgl. Efektif	25 September 2024						

SURAT KETERANGAN HASIL UJI TURNITIN

Nama : ACHMAD ILHAM FAUZAN
NIM : 43122010336
Fakultas / Program Studi : FEB / Manajemen
Jenis : Skripsi
Judul Tugas Akhir : ANALISIS PERGERAKAN INDEX IDX-30 MENGGUNAKAN METODE AUTO
REGRESIVE INTEGRATED MOVING AVERAGE (ARIMA) SAAT DAN
SETELAH PANDEMI COVID 19 1
Hasil Pengecekan Turnitin : 26%

Telah dilakukan pengecekan Similarity menggunakan aplikasi **Turnitin** dengan hasil presentase kemiripan sebesar **26%** dan dinyatakan memenuhi syarat untuk penyerahan tugas akhir sesuai dengan ketentuan yang berlaku di Universitas Mercu Buana. Hasil uji Turnitin terlampir.

Demikian surat keterangan ini dibuat dan digunakan sebagaimana mestinya.

Jakarta, 12 August 2026
Kepala Biro Perpustakaan

UNIVERSITAS
MERCU BUANA



Muhammad Arif Budiyanto, M.Hum

Ket: Surat keterangan ini sebagai salah satu syarat untuk penyerahan tugas akhir.

2026/Agustus/12/0000001175/Muhammad Arif Budiyanto, M.Hum

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Tugas Akhir ini diajukan oleh:

Nama : Achmad Ilham Fauzan

NIM : 43122010336

Fakultas/Program Studi : Ekonomi dan Bisnis/S1 Manajemen

Judul Tugas Akhir : Analisis Pergerakan Index IDX-30 Menggunakan Metode Auto Regressive Integrated Moving Average (ARIMA) Saat dan Setelah Pandemi Covid-19

Telah berhasil dipertahankan pada sidang tanggal 02 Juli 2026 dan diterima sebagai bagian persyaratan yang diperlukan untuk memperoleh gelar Sarjana pada Program Studi S1 Manajemen, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Mercu Buana.

Disahkan oleh :

Pembimbing



Dr. Agus Herta Sumarto, SP., M.Si
NIDN/NUPTK: 0322088502

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Ketua Program Studi S1 Manajemen



Dr. Nurul Hidayah, M.Si., Ak., CA
NIDN/NUPTK: 0307036901



Dudi Permana, Ph.D
NIDN/NUPTK: 1018037701

LPTA-07266464



Scan QR or [click here](#) to
Verification

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan atas kehadiran Allah SWT yang telah memberikan Rahmat dan karunia-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul ”**Analisis Pergerakan Index IDX-30 Menggunakan Metode *Auto Regresive Integrated Moving Average (ARIMA)* Saat Dan Setelah Pandemi Covid-19**” Skripsi ini merupakan syarat untuk memperoleh gelar sarjana pada Program Studi S1 Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.

Penyusunan skripsi ini tidak lepas dari bimbingan, bantuan, dan dukungan yang sangat berarti dari berbagai pihak. Oleh karena itu, dalam kesempatan ini penulis ingin berterima kasih pada semua pihak yang telah membantu dalam penyusunan skripsi ini terutama kepada :

1. Prof. Dr. Ir. Andi Adriansyah, M. Eng, selaku Rektor Universitas Mercu Buana.
2. Prof Dr. Nurul Hidayah, M. Si. Ak, selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.
3. Dudi Permana, Ph. D., selaku Ketua Program Studi S1 Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis di Universitas Mercu Buana.
4. Dr. Agus Herta Sumarto, Sp., M.Si, selaku dosen pembimbing proposal skripsi yang telah memberikan bimbingan, ilmu, semangat, motivasi, saran, serta waktu luang selama proses penyusunan proposal ini.
5. Seluruh dosen dan *staff* program studi Manajemen S1 Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana yang telah memberikan ilmu dan bantuan selama masa studi.
6. Keluarga besar terutama Papah Syauqi, Ibu Dewi dan adek Dara yang selalu memberikan doa, dukungan, semangat, serta memberikan banyak inspirasi yang tiada hentinya kepada penulis.

7. Kepada teman – teman studi Manajemen Angkatan 2022 Mercu Buana Meruya dan teman bimbingan yang selalu memberikan semangat selama masa studi.

8. Kepada teman – teman KSPM yang sudah memberikan dukungan dan semangat kepada penulis selama masa penelitian dibuat.

Penulis menyadari bahwa skripsi ini masih jauh dari sempurna dan membutuhkan saran serta masukan yang konstruktif. Oleh karena itu, penulis sangat mengharapkan kritik dan saran yang membangun dari berbagai pihak untuk perbaikan dan penyempurnaan skripsi ini di masa mendatang. Semoga skripsi ini dapat memberikan manfaat dan kontribusi positif bagi pembaca serta pihak – pihak yang berkepentingan.

Jakarta, 6 Juni 2026

Achmad Ilham Fauzan

43122010336



HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI
TUGAS AKHIR DI REPOSITORI UMB

Sebagai sivitas akademik Universitas Mercu Buana, Saya yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : Achmad Ilham Fauzan

Nim : 43122010336

Fakultas/Program Studi : Ekonomi dan Bisnis/Manajemen

Judul Tugas Akhir : Analisis Pergerakan Index IDX-30 Menggunakan Metode Auto Regressive Integrated Moving Average (ARIMA) Saat dan Setelah Pandemi Covid-19

Demi pengembangan ilmu pengetahuan, dengan ini memberikan izin dan menyetujui untuk memberikan kepada Universitas Mercu Buana Hak Bebas Royalti Non-Eksklusif (*Non-exclusive Royalti-Free Right*) atas karya ilmiah saya berjudul di atas beserta perangkat yang (jika diperlukan) Dengan Hak Bebas Royalti Non-Eksklusif ini Universitas Mercu Buana berhak menyimoan, mengalih media/format-kan, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*). merawat dan mempublikasikan Tugas Akhir saya selama tetap mencantumkan nama saya sebagai penulis/pencipta dan sebagai pemilik Hak Cipta.

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Jakarta 14 Agustus 2026

Yang Menyatakan

UNIVERSITAS
MERCU BUANA



Achmad Ilham Fauzan

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pergerakan indeks IDX30 selama dua periode berbeda, yaitu saat pandemi COVID-19 (2020–2022) dan setelah pandemi (2023–2025), menggunakan metode *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA). IDX30 dipilih karena mencerminkan saham-saham unggulan di Bursa Efek Indonesia yang memiliki likuiditas tinggi dan kapitalisasi pasar besar. Metode ARIMA dipilih karena kemampuannya dalam menangani data deret waktu non-stasioner dan telah terbukti efektif dalam berbagai studi keuangan. Data yang digunakan merupakan data harga penutupan harian yang diperoleh dari situs Investing.com. Analisis dilakukan dengan membagi data menjadi dua periode, mengestimasi model ARIMA untuk masing-masing periode. Hasil penelitian ini diharapkan dapat memberikan pemahaman mendalam tentang keandalan model ARIMA dalam memprediksi pergerakan harga saham dalam kondisi ekonomi yang berbeda, serta memberikan referensi bagi investor dan pengambil kebijakan dalam menyusun strategi investasi yang responsif terhadap dinamika pasar.

Kata kunci: ARIMA, IDX30, COVID-19, Peramalan Saham, Time Series.



ABSTRACT

This study aims to analyze the movement of the IDX30 index during two different periods, namely during the COVID-19 pandemic (2020–2022) and after the pandemic (2023–2025), using the Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) method. IDX30 was selected as the research object because it represents blue-chip stocks in the Indonesia Stock Exchange with high liquidity and large market capitalization. ARIMA was chosen due to its effectiveness in modeling non-stationary time series data and its proven performance in various financial studies. The data used consists of daily closing prices obtained from Investing.com. This study is expected to provide a comprehensive understanding of the reliability of the ARIMA model in forecasting stock price movements under different economic conditions, as well as offer valuable insights for investors and policymakers in developing responsive investment strategies.

Keywords: ARIMA, IDX30, COVID-19, Stock Forecasting, Time Series.



DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	0
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERNYATAAN KARYA SENDIRI	ii
PERNYATAAN SIMILARITY CHECK	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI TUGAS AKHIR DI REPOSITORI UMB	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah	13
C. Tujuan Penelitian	13
D. Kontribusi Penelitian	13
BAB II	15
KAJIAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	15
A. Kajian Pustaka	15
B. Penelitian Terdahulu	24
C. Kerangka Konseptual	27

BAB III	28
METODOLOGI PENELITIAN	28
A. Waktu Dan Tempat Penelitian	28
B. Desain Penelitian	28
C. Teknik Pengumpulan Data	29
D. Populasi dan Sampel Penelitian	30
E. Metode Analisis Data	33
BAB IV	35
HASIL DAN PEMBAHASAN	35
4.2 Uji Stasioneritas Data Saat Pandemi Covid-19	36
4.3 Estimasi dan Evaluasi Model ARIMA(0,1,2)	40
4.4 Uji Stasioneritas Data Setelah Pandemi Covid-19	41
4.5 Spesifikasi Model ARIMA Setelah Pandemi Covid-19	44
4.6 Estimasi dan Evaluasi Model ARIMA (7,1,5)	45
4.7 Pembahasan	47
4.7.1 Evaluasi Kelayakan Metode ARIMA pada Periode Saat Pandemi COVID-19	47
4.7.2. Evaluasi Kelayakan Metode ARIMA pada Periode Setelah Pandemi COVID-19	48
BAB V	50
SIMPULAN DAN SARAN	50
5.1 Simpulan	50
5.2 Saran	50
DAFTAR PUSTAKA	52
LAMPIRAN.....	55

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	24
Tabel 3.1 Sampel Penelitian.....	31
Tabel 4.1 Proses Pengecekan Stasioneritas Index IDX-30 saat Pandemi Covid-19.....	36
Tabel 4.2 Proses Diffrencing Index IDX-30 saat Pandemi Covid-19.....	37
Tabel 4.4 Proses Pengecekan Stasioneritas Index IDX-30 setelah Pandemi Covid-19 First Diffrencing.....	42
Tabel 4.5 Nilai Cut-Off ACF dan PACF (Setelah Differencing).....	44
Tabel 4.6 Hasil Estimasi Model ARIMA (7,1,5).....	45



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Pergerakan Harga Saham Index IHSG,IDX-30 dan LQ45	7
Gambar 2. 1 Kerangka Konseptual	28
Gambar 4.1 Data Pergerakan Index IDX-30 Saat dan Setelah Pandemi Covid-19	35
Gambar 4.3 Proses Spesifikasi Model ARIMA Saat Pandemi Covid-19.....	38



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Pergerakan Index IDX-30 Saat dan Setelah Pandemi Covid-19.....	55
Lampiran 2. Uji Stasionaritas Index IDX-30 Saat dan Setelah Pandemi.....	55
Lampiran 3. Model ARIMA Saat Pandemi Covid-19.....	55
Lampiran 4. Model ARIMA Setelah Pandemi Covid-19.....	56

