

LEMBAR
HASIL PENILAIAN SEJAWAT SEBIDANG ATAU *PEER REVIEW*
KARYA ILMIAH : KARYA CIPTAAN

Judul Karya Ciptaan : Aplikasi R-GUI : Autoregressive Fractional Integrated Moving Average (ARFIMA) untuk Prediksi Harga Saham
Nama Inventor /Jumlah Inventor : Tarno, Maria Sekarwulan Kumala Raharja, Puspita Kartikasari / 3
Status Pengusul : Inventor ke-3
Identitas Karya Ciptaan : a. Pemegang Hak Cipta : Universitas Diponegoro
b. Jenis Ciptaan : Program Komputer
c. Tanggal Permohonan : 12 Mei 2022
d. Nomor Permohonan : EC0020229154
e. Tanggal diumumkan : 27 Maret 2022
f. Tempat diumumkan : Semarang
g. Nomor Pencatatan : 000344714
h. Alamat Web Sertifikat : <https://e-hakcipta.dgip.go.id/index.php/c?code=-ZWM3YjExNzBIYThkN2U4ZjdhNjM5YTQyMDYzNTI2YWQK>

DESKRIPSI :

Aplikasi GUI R: Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average (ARFIMA) untuk Prediksi Harga Saham merupakan aplikasi GUI R yang disusun untuk membantu penelitian mengenai peramalan (*forecasting*) dengan metode *time series Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average* (ARFIMA). Aplikasi ini dilengkapi dengan beberapa fitur uji yang umumnya digunakan dalam melakukan peramalan seperti, uji Augmented Dickey-Fuller, uji statistik Hurst berdasarkan nilai R/S (*Rescaled Range Statistic*), GPH estimator, uji normalitas Kolmogorov-Smirnov, uji Lagrange Multiplier, dan lain-lain. Model ARFIMA mampu meramalkan data saham yang memiliki permasalahan efek *long memory* atau jangka panjang tanpa memperhitungkan heteroskedastisitas dalam residual data.