

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

Judul Karya Ciptaan : Aplikasi R-GUI : Autoregressive Fractional Integrated Moving Average dengan Efek Garch (ARFIMA-GARCH) untuk Prediksi Harga Saham

Nama Inventor /Jumlah Inventor : Puspita Kartikasari, Maria Sekarwulan Kumala Raharja, Tarno / 3

Status Pengusul : Inventor ke-1

Identitas Karya Ciptaan : a. Pemegang Hak Cipta : Universitas Diponegoro
b. Jenis Ciptaan : Program Komputer
c. Tanggal Permohonan : 13 September 2022
d. Nomor Permohonan : EC00202264209
e. Tanggal diumumkan : 23 Maret 2022
f. Tempat diumumkan : Semarang
g. Nomor Pencatatan : 000379945
h. Alamat Web Sertifikat : <https://e-hakcipta.dgip.go.id/index.php/c?code=YTYzYmFmYWVmNzFIYTlmMTk5NDRmMTFmYWFiZmY2NzgK>

DESKRIPSI :

Aplikasi GUI R: Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average dengan Efek GARCH (ARFIMA – GARCH) 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* dengan efek GARCH (ARFIMA – GARCH). 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 – GARCH tersebut mampu meramalkan data saham yang memiliki permasalahan efek long memory atau jangka panjang dengan memperhitungkan heteroskedastisitas dalam residual data.