

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
ABSTRAK.....	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GRAFIK dan GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Permasalahan	6
1.3 Tujuan.....	7
1.3.1 Tujuan Penelitian	7
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	7
1.4 Sitematika Penulisan.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Pasar Modal	10
2.1.2 Investasi	11
2.1.3 Strategi Investasi pasif.....	11
2.1.4 Strategi Investasi Aktif.....	13
2.1.5 Efisiensi Pasar Modal.....	15
2.1.6 Teknik Analisis Saham.....	17
2.1.6.1 Analisis Fundamental.....	18
2.1.6.2 Analisis Teknikal.....	19
2.1.7 Multifraktalitas.....	22
2.1.8 Metode Analisis Teknikal.....	23

2.1.8.1 ARIMA	24
2.1.8.1.1 Notasi dalam Metode ARIMA.....	26
2.1.8.1.2 Model Autoregressive (AR).....	27
2.1.8.1.3 Model Moving Average(MA).....	28
2.1.8.1.4 Model ARMA.....	29
2.1.8.1.5 Model ARIMA.....	29
2.1.8.2 Jaringan Syaraf Tiruan.....	30
2.1.8.3 Komponen Jaringan Syaraf.....	36
2.1.8.4 Arsitektur Jaringan Syaraf.....	38
2.1.8.4.1 Jaringan Dengan Lapisan Tunggal.....	38
2.1.8.4.2 Jaringan Dengan banyak Lapisan	38
2.1.8.5 Fungsi Aktivasi	38
2.1.8.6 Proses Pembelajaran	44
2.1.8.7 Jaringan Syaraf tiruan untuk prediksi data deret waktu	48
2.1.8.8 Galat Propagasi Balik.....	49
2.2 Penelitian Terdahulu.....	53
2.2.1 Multifraktalitas.....	53
2.2.2 ARIMA.....	54
2.2.3 Jaringan Syaraf Tiruan.....	57
2.3 Kerangka Pemikiran.....	64
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	66
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	66
3.2 Populasi dan Sampel.....	66
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	68
3.4. Metode Pengumpulan Data.....	68
3.5 Metode Analisis.....	68
3.5.1 Multifraktalitas	68
3.5.2 Metode ARIMA.....	71
3.5.2.1 Stasioneritas Data.....	72
3.5.2.2 Tahapan Metode ARIMA.....	75
3.5.3 Metode Jaringan Syaraf Tiruan.....	80
3.5.3.1 Fungsi Aktivasi.....	81

3.5.3.2	Pelatihan Standard Propagasi Balik.....	82
3.5.3.3	Algoritma Pelatihan.....	84
3.5.4	Pengukuran Kinerja.....	86
3.5.4.1	Mean Squared Error.....	86
3.5.4.2	Komparasi Hasil Peramalan.....	87
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN.....	88
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	88
4.1.1	Kelompok Saham LQ45.....	88
4.1.2	Statistika Deskriptif Objek Penelitian.....	89
4.2	Analisis Data.....	91
4.2.1	Multifraktalitas	91
4.2.2	Model ARIMA	93
4.2.2.1	Uji Stasioneritas Data.....	94
4.2.2.2	Identifikasi Model.....	97
4.2.2.3	Estimasi.....	99
4.2.2.4	Diagnostic Checking.....	99
4.2.2.5	Peramalan.....	101
4.2.3	Jaringan Syaraf Tiruan.....	102
4.3	Pembahasan	106
4.3.1	Multifraktalitas.....	106
4.3.2	ARIMA.....	107
4.3.3	Jaringan Syaraf Tiruan.....	108
4.3.4	Komparasi Hasil Peramalan.....	108
Bab V	PENUTUP.....	109
5.1	Kesimpulan.....	109
5.2	Saran	110

DAFTAR PUSTAKA	111
LAMPIRAN-LAMPIRAN	113