

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN PENGUJI	ii
HALAMAN PENGESAHAN PEMBIMBING	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
HALAMAN PENGESAHAN	v
MOTTO	vi
KATA PENGANTAR	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR SINGKATAN	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	3
1.3 Perumusan Masalah	15
1.4 Tujuan Penelitian	16
1.5 Manfaat Penelitian	17
1.6 Sistematika Penulisan	17
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	18
2.1 Metode Statistik Klasik (AutoRegressive Integrated Moving Average – ARIMA)	18
2.2 Deep Learning (Long Short Term Memory – LSTM)	20
2.3 Machine Learning (Artificial Neural Network – ANN)	23
2.4 Efficient Market Hypothesis (EMH)	27

2.5	Saham.....	28
2.6	Strategi Investasi Saham	30
2.7	Penelitian Terdahulu	32
2.8	Kerangka Pemikiran.....	44
2.8.1	Harga Historis Saham dan Data Preprocessing	45
2.8.2	Pemodelan Prediksi AutoRegressive Integrated Moving Average (ARIMA) 45	
2.8.3	Pemodelan Prediksi Long Short-Term Memory (LSTM)	46
2.8.4	Pemodelan Prediksi Artificial Neural Network (ANN).....	46
2.8.5	Evaluasi Akurasi Model : MAE, RMSE, MAPE.....	47
2.8.6	Implementasi Model untuk Memperoleh Sinyal Investasi	47
2.8.7	Analisis dan Perbandingan Hasil	47
2.9	Hipotesis Penelitian	47
2.10	Lingkup Penelitian	48
2.10.1	Objek Penelitian.....	49
2.10.2	Waktu dan Periode Penelitian.....	49
2.10.3	Variabel Penelitian.....	49
BAB 3 METODE PENELITIAN		51
3.1	Jenis Penelitian.....	51
3.1.1	Pengertian Jenis Penelitian	51
3.1.2	Karakteristik Penelitian.....	52
3.1.3	Relevansi Jenis Penelitian terhadap Tujuan Studi	53
3.2	Operasional Penelitian	53
3.2.1	Variabel Independen	54
3.2.2	Variabel Dependen.....	54
3.3	Tahapan Penelitian.....	56
3.4	Populasi dan Sampel	57

3.4.1	Populasi.....	57
3.4.2	Sampel.....	58
3.5	Pengumpulan Data	59
3.5.2	Sumber Data.....	59
3.6	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	61
3.6.1	Teknik Analisis Data.....	61
3.6.2	Pengujian Hipotesis	63
BAB 4	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	64
4.1	Deskripsi Data dan Pemodelan	64
4.2	Implementasi Model	64
4.2.1	Model AutoReggresive Integrated Moving Average.....	64
4.2.2	Model Artificial Neural Network.....	65
4.2.3	Model Long Short-Term Memory	65
4.3	Perbandingan Akurasi, Hasil evaluasi dan Uji Statistik	66
4.3.1	Hasil Evaluasi dan Data Testing.....	66
4.3.2	Uji Statistik Pengujian Hipotesis	67
4.3.3	Analisis Visualisasi Prediksi.....	69
4.3.4	Rangkuman Performa Model.....	75
4.4	Analisis Temuan	76
4.4.1	Analisis Teoritis	76
4.4.2	Analisis Praktis	78
BAB 5	KESIMPULAN DAN SARAN	80
5.1	Kesimpulan	80
5.2	Saran	81
DAFTAR PUSTAKA		82
LAMPIRAN.....		90