

DAFTAR ISI

Lembar Pernyataan.....	i
Lembar Pengesahan	ii
Abstrak	iii
<i>Abstract</i>	iv
Lembar Persembahan	v
Kata Pengantar	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL.....	xvi
DAFTAR PERSAMAAN	xvii
1 Pendahuluan.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	2
1.3 Tujuan	2
1.4 Batasan Masalah	3
1.5 Metodologi Penyelesaian Masalah	3
1.6 Sistematika Penulisan	4
2 Dasar Teori.....	5
2.1 Pengertian Pasar Modal	5
2.2 Saham.....	5
2.3 Indeks Saham	6
2.3.1 Pembagian Angka Indeks.....	7
2.3.2 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	8
2.3.3 Indeks LQ45	8
2.3.4 Jakarta <i>Islamic Indeks</i>	9
2.3.5 Metodologi Perhitungan Indeks Harga Saham	9
2.4 <i>Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)</i>	10

2.4.1	Proses Modeling.....	12
2.5	Genetic Programming	15
2.5.1	Representasi Individu.....	16
2.5.2	Inisialisasi Populasi.....	17
2.5.3	<i>Fitness</i>	19
2.5.4	Seleksi Orang Tua.....	20
2.5.5	Rekombinasi.....	20
2.5.6	Mutasi.....	22
2.6	Gabungan ARIMA dan <i>Genetic Programming</i>	22
3	Perancangan Sistem.....	24
3.1	Deskripsi Sistem	24
3.2	Rancangan Umum Sistem.....	24
3.3	Data.....	25
3.4	Stasionerisasi.....	25
3.5	ARIMA	26
3.6	<i>Genetic Programming</i>	26
3.7	Kinerja Model	27
4	Hasil dan Analisis.....	29
4.1	Pengujian Data	29
4.2	Skenario	29
4.2.1	Skenario 1: Peramalan Indeks IHSG dengan Menggunakan ARIMA 29	
4.2.2	Skenarion 2: Peramalan Indeks LQ45 dengan Menggunakan ARIMA 29	
4.2.3	Skenario 3: Peramalan Indeks JII dengan Menggunakan ARIMA . 29	
4.2.4	Skenario 4: Peramalan Indeks IHSG dengan Menggunakan ARIMA dan GP 30	
4.2.5	Skenario 5: Peramalan Indeks LQ45 dengan Menggunakan ARIMA dan GP 30	
4.2.6	Skenario 6: Peramalan Indeks JII dengan Menggunakan ARIMA dan GP 30	
4.3	Hasil dan Analisis	30

4.3.1	Peramalan Indeks IHSG dengan Menggunakan ARIMA	30
4.3.2	Peramalan Indeks LQ45 dengan Menggunakan ARIMA	41
4.3.3	Peramalan Indeks JII dengan Menggunakan ARIMA	53
4.3.4	Peramalan Indeks IHSG dengan Menggunakan ARIMA dan GP ..	66
4.3.5	Peramalan Indeks LQ45 dengan Menggunakan ARIMA dan GP ..	68
4.3.6	Peramalan Indeks JII dengan Menggunakan ARIMA dan GP	68
4.4	Perbandingan <i>Error</i> Antar Indeks dan Perbandingan Hasil Prediksi ARIMA dan GP dengan ARIMA Saja.....	69
4.4.1	Perbandingan Error Antar Indeks.....	69
4.4.2	Perbandingan Hasil Prediksi ARIMA dan GP dengan ARIMA saja	69
5	Kesimpulan dan Saran	74
5.1	Kesimpulan	74
5.2	Saran	74
	Daftar Pustaka.....	75
	Lampiran 1: Data Indeks Saham IHSG	76
	Lampiran 2: Data Indeks Saham LQ45.....	78
	Lampiran 3: Data Training Indeks Saham JII	80
	Lampiran 4: Fungsi Hasil <i>Genetic Programming</i> untuk Indeks IHSG	82
	Lampiran 5: Fungsi Hasil <i>Genetic Programming</i> untuk Indeks LQ45	92
	Lampiran 6: Fungsi Hasil <i>Genetic Programming</i> untuk Indeks JII.....	94