

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I .....	ii
HALAMAN PENGESAHAN II.....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
ABSTRAK .....	v
ABSTRACT.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Batasan Masalah .....	7
1.4 Tujuan Penelitian .....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Saham.....	9
2.2 Harga Saham.....	11
2.3 <i>Data Time Series</i> .....	13

2.4	Uji Linearitas Terasvirta .....	17
2.5	<i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF).....	19
2.6	Peramalan.....	20
2.7	<i>Support Vector Regression</i> (SVR).....	23
2.8	<i>Kernel Radial Basis Function</i> (RBF).....	33
2.9	<i>Genetic Algorithm</i> (GA) .....	34
2.9.1	Pengantar <i>Genetic Algorithm</i> .....	34
2.9.2	Proses <i>Genetic Algorithm</i> .....	37
2.9.3	Proses Manual <i>Genetic Algoritithm</i> .....	43
2.10	<i>Grid Search</i> (GS) .....	50
2.11	Pengukuran Kinerja Prediksi .....	51
BAB III METODE PENELITIAN.....		54
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	54
3.2	Variabel Penelitian.....	54
3.3	Tahapan Analisis Data .....	55
3.4	Diagram Alir Analisis Data .....	58
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....		59
4.1	Analisis Deskriptif .....	59
4.2	<i>Preprocessing</i> Data.....	60
4.2.1	Penentuan Variabel Input.....	61
4.2.2	Deteksi <i>Missing Value</i> .....	62

4.2.3	Pembagian Data <i>Training</i> dan <i>Testing</i> .....	62
4.3	Penerapan Uji Terasvirta dalam Mengidentifikasi Linearitas Model .....	64
4.4	<i>Support Vector Regression</i> Tanpa Optimasi ( <i>Default</i> ) .....	65
4.4.1	Pembentukan Model pada Data <i>Training</i> .....	65
4.4.2	Evaluasi Model pada Data <i>Testing</i> .....	67
4.5	<i>Support Vector Regression – Genetic Algorithm</i> .....	70
4.5.1	Pembentukan Model pada Data <i>Training</i> .....	70
4.5.2	Evaluasi Model pada Data <i>Testing</i> .....	81
4.6	<i>Support Vector Regression – Grid Search</i> .....	83
4.6.1	Pembentukan Model pada Data <i>Training</i> .....	83
4.6.2	Evaluasi Model pada Data <i>Testing</i> .....	84
4.7	Perbandingan Kinerja.....	87
4.8	Peramalan 15 Periode ke Depan .....	88
BAB V PENUTUP.....		90
5.1	Kesimpulan .....	90
5.2	Saran .....	91
DAFTAR PUSTAKA .....		93
LAMPIRAN.....		97