

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN I	iii
HALAMAN PENGESAHAN II.....	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vi
<i>ABSTRACT</i>	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Batasan Masalah	5
1.4 Tujuan Penelitian	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Peramalan.....	7
2.2 Analisis Deret Waktu (<i>Time Series</i>) dan Pola Data.....	8
2.3 Kestasioneran.....	10
2.4 Fungsi Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial.....	13
2.5 Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	16
2.6 Model <i>Moving Average</i> (MA)	17
2.7 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	18

2.8	Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA).....	18
2.9	<i>Long Short Term Memory</i> (LSTM).....	20
2.9.1	Fungsi Aktivasi	31
2.9.2	Model <i>Long Short Term Memory</i> (LSTM)	32
2.10	Model <i>Hybrid</i> ARIMA-LSTM	36
2.11	Uji Linearitas	36
2.12	Pengecekan Diagnostik (<i>Diagnostic Checking</i>).....	37
2.13	Evaluasi performa Model.....	41
BAB III METODE PENELITIAN.....		38
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	38
3.2	Variabel Penelitian.....	38
3.3	Tahapan Analisis.....	39
3.4	Diagram Alir Analisis Data	42
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		44
4.1	Analisis Deskriptif Data Indeks Harga Saham Gabungan.....	44
4.2	Pengecekan Kestasioneran.....	46
4.3	Peramalan IHSG Menggunakan Model ARIMA.....	48
4.3.1	Penentuan Spesifikasi Model ARIMA.....	48
4.3.2	Uji Signifikansi Parameter	50
4.3.3	Uji Diagnostik Residual ARIMA.....	53
4.3.4	Hasil Pemodelan ARIMA	58
4.4	Peramalan IHSG Menggunakan Model LSTM	60
4.4.1	Uji Linearitas.....	60
4.4.2	Normalisasi dan Arsitektur Model LSTM	61

4.4.3	Hasil Peramalan IHSG Menggunakan Model LSTM.....	62
4.5	Peramalan IHSG Menggunakan Model <i>Hybrid</i> ARIMA-LSTM	64
4.5.1	Prediksi Residual dengan LSTM	65
4.5.2	Hasil Peramalan IHSG Menggunakan Model <i>Hybrid</i>	66
4.6	Pemilihan Model Terbaik	68
4.7	Peramalan IHSG Menggunakan Model Terbaik.....	69
BAB V PENUTUP.....		71
5.1	Kesimpulan	71
5.2	Saran	72
DAFTAR PUSTAKA		73
LAMPIRAN.....		76