

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAK	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	14
1.1 Latar Belakang	14
1.2 Rumusan Masalah	16
1.3 Batasan Masalah	16
1.4 Tujuan Penelitian	17
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	18
2.1 Saham	18
2.2 NVIDIA	19
2.3 Analisis Runtun Waktu	20
2.4 Stasioneritas Deret Waktu	22
2.4.1 Transformasi Box-Cox	23
2.4.2 Uji Akar Unit Augmented Dickey Fuller (ADF)	29
2.4.3 Fungsi Autokorelasi (ACF)	31
2.4.4 Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF)	32
2.5 Model Runtun Waktu Stasioner	34
2.5.1 Model Autoregressive (AR)	34
2.5.2 Model <i>Moving Average</i> (MA)	35
2.5.3 Model Autoregressive Moving Average (ARMA)	36
2.6 Model Runtun Waktu Non Stasioner	37
2.6.1 Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)	38
2.6.2 Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Subset	38

2.7	Estimasi Parameter Model ARIMA.....	39
2.8	Uji Signifikansi Parameter.....	44
2.9	Uji Diagnostik Model ARIMA.....	45
2.9.1.	Uji Kolmogorov-Smirnov (Normalitas Residual).....	45
2.9.2.	Uji Ljung-Box (Independensi Residual).....	46
2.9.3.	Uji Homoskedastisitas Residual.....	47
2.10	Artificial Neural Network.....	48
2.10.1.	Arsitektur Jaringan Syaraf Tiruan.....	49
2.10.2.	Fungsi Aktivasi.....	50
2.11	<i>Backpropagation</i>	51
2.11.1	Arsitektur Jaringan <i>Backpropagation</i>	51
2.11.2	Model <i>Backpropagation</i>	52
2.11.3	Pelatihan <i>Backpropagation</i>	53
2.12	<i>Hyperparameter</i>	55
2.13	<i>Hybrid</i> ARIMA-ANN.....	56
2.14	Pemilihan Model Terbaik.....	57
2.15	Evaluasi Model.....	58
BAB III METODE PENELITIAN.....		60
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	60
3.2	Variabel Penelitian.....	60
3.3	Tahapan Analisis Data.....	60
3.4	Diagram Alir Analisis Data.....	64
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		66
4.1	Deskripsi Data.....	66
4.2	Stasioneritas dalam Varian.....	67
4.3	Stasioneritas dalam Mean.....	68
4.4	Stasioneritas dalam Mean setelah <i>differencing</i>	69
4.5	Identifikasi Model ARIMA.....	71
4.6	Estimasi Parameter Model ARIMA.....	72
4.7	Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA.....	73
4.8	Uji Normalitas Residual.....	75
4.9	Uji Independensi Residual.....	76

4.10	Uji Homoskedastisitas Residual	78
4.11	Pemilihan Model ARIMA Terbaik	79
4.12	Evaluasi Model ARIMA	81
4.13	Pemodelan ANN	82
4.14	Proses <i>Backpropagation</i>	84
4.15	Model <i>Hybrid</i> ARIMA-ANN	89
4.16	Evaluasi Model ARIMA-ANN	90
4.17	Ukuran Kebaikan Model ARIMA dengan <i>Hybrid</i> ARIMA-ANN	91
4.18	Evaluasi Kinerja Model Terbaik	91
BAB V PENUTUP		93
5.1.	Kesimpulan	93
5.2.	Saran	94
DAFTAR PUSTAKA		96
LAMPIRAN		99