

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
ABSTRAK.....	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GRAFIK dan GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Permasalahan .....	6
1.3 Tujuan.....	7
1.3.1 Tujuan Penelitian .....	7
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	7
1.4 Sitematika Penulisan.....	8
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>10</b>
2.1 Landasan Teori .....	10
2.1.1 Pasar Modal .....	10
2.1.2 Investasi .....	11
2.1.3 Strategi Investasi pasif.....	11
2.1.4 Strategi Investasi Aktif.....	13
2.1.5 Efisiensi Pasar Modal.....	15
2.1.6 Teknik Analisis Saham.....	17
2.1.6.1 Analisis Fundamental.....	18
2.1.6.2 Analisis Teknikal.....	19
2.1.7 Multifraktalitas.....	22
2.1.8 Metode Analisis Teknikal.....	23

2.1.8.1 ARIMA .....	24
2.1.8.1.1 Notasi dalam Metode ARIMA.....	26
2.1.8.1.2 Model Autoregressive (AR).....	27
2.1.8.1.3 Model Moving Average(MA).....	28
2.1.8.1.4 Model ARMA.....	29
2.1.8.1.5 Model ARIMA.....	29
2.1.8.2 Jaringan Syaraf Tiruan.....	30
2.1.8.3 Komponen Jaringan Syaraf.....	36
2.1.8.4 Arsitektur Jaringan Syaraf.....	38
2.1.8.4.1 Jaringan Dengan Lapisan Tunggal.....	38
2.1.8.4.2 Jaringan Dengan banyak Lapisan .....	38
2.1.8.5 Fungsi Aktivasi .....	38
2.1.8.6 Proses Pembelajaran .....	44
2.1.8.7 Jaringan Syaraf tiruan untuk prediksi data deret waktu	48
2.1.8.8 Galat Propagasi Balik.....	49
2.2 Penelitian Terdahulu.....	53
2.2.1 Multifraktalitas.....	53
2.2.2 ARIMA.....	54
2.2.3 Jaringan Syaraf Tiruan.....	57
2.3 Kerangka Pemikiran.....	64
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....</b>	<b>66</b>
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	66
3.2 Populasi dan Sampel.....	66
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	68
3.4. Metode Pengumpulan Data.....	68
3.5 Metode Analisis.....	68
3.5.1 Multifraktalitas .....	68
3.5.2 Metode ARIMA.....	71
3.5.2.1 Stasioneritas Data.....	72
3.5.2.2 Tahapan Metode ARIMA.....	75
3.5.3 Metode Jaringan Syaraf Tiruan.....	80
3.5.3.1 Fungsi Aktivasi.....	81

3.5.3.2	Pelatihan Standard Propagasi Balik.....	82
3.5.3.3	Algoritma Pelatihan.....	84
3.5.4	Pengukuran Kinerja.....	86
3.5.4.1	Mean Squared Error.....	86
3.5.4.2	Komparasi Hasil Peramalan.....	87
<b>BAB IV</b>	<b>HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>88</b>
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	88
4.1.1	Kelompok Saham LQ45.....	88
4.1.2	Statistika Deskriptif Objek Penelitian.....	89
4.2	Analisis Data.....	91
4.2.1	Multifraktalitas .....	91
4.2.2	Model ARIMA .....	93
4.2.2.1	Uji Stasioneritas Data.....	94
4.2.2.2	Identifikasi Model.....	97
4.2.2.3	Estimasi.....	99
4.2.2.4	Diagnostic Checking.....	99
4.2.2.5	Peramalan.....	101
4.2.3	Jaringan Syaraf Tiruan.....	102
4.3	Pembahasan .....	106
4.3.1	Multifraktalitas.....	106
4.3.2	ARIMA.....	107
4.3.3	Jaringan Syaraf Tiruan.....	108
4.3.4	Komparasi Hasil Peramalan.....	108
<b>Bab V</b>	<b>PENUTUP.....</b>	<b>109</b>
5.1	Kesimpulan.....	109
5.2	Saran .....	110

<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	<b>111</b>
<b>LAMPIRAN-LAMPIRAN</b> .....	<b>113</b>