



UNIVERSITAS  
GADJAH MADA

ANALISIS FLUKTUASI HARGA SAHAM HARIAN MENGGUNAKAN PENDEKATAN ENTROPI  
BOLTZMANN-GIBBS SELAMA KRISIS  
KEUANGAN GLOBAL : STUDI KASUS PADA SAHAM PERUSAHAAN YANG TERGABUNG DALAM  
INDEKS BISNIS-27

SASA TIAN DHANI, 1. Dr. Dwi Satya Palupi, S.Si, M.Si

Universitas Gadjah Mada, 2022 | Diunduh dari <http://ejournal.repository.ugm.ac.id/>

## DAFTAR ISI

<b>Halaman Judul</b>	<b>ii</b>
<b>Halaman Pengesahan</b>	<b>iii</b>
<b>Halaman Pernyataan</b>	<b>iv</b>
<b>Halaman Persembahan</b>	<b>v</b>
<b>Halaman Motto</b>	<b>vi</b>
<b>PRAKATA</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMBANG</b>	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b>	<b>xiv</b>
<b>INTISARI</b>	<b>xv</b>
<b>ABSTRACT</b>	<b>xvi</b>
<b>I PENDAHULUAN</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian .....	4
1.4 Batasan Masalah.....	5
1.5 Manfaat Penelitian.....	5
1.6 Tinjauan Penelitian.....	5
1.7 Metode Penelitian.....	8
1.8 Sistematika Penulisan Skripsi.....	11
<b>II LANDASAN TEORI</b>	<b>12</b>
2.1 Fisika dan Ekonomi.....	12
2.2 Hukum Termodinamika II dan Entropi.....	13
2.2.1 Implikasi Hukum Termodinamika II dan Entropi.....	15
2.2.2 Entropi dalam Termodinamika.....	16
2.2.3 Entropi dalam Mekanika Statistik.....	18



**ANALISIS FLUKTUASI HARGA SAHAM HARIAN MENGGUNAKAN PENDEKATAN ENTROPI  
BOLTZMANN-GIBBS SELAMA KRISIS  
KEUANGAN GLOBAL : STUDI KASUS PADA SAHAM PERUSAHAAN YANG TERGABUNG DALAM  
INDEKS BISNIS-27**

UNIVERSITAS  
GADJAH MADA

SASA TIAN DHANI, 1. Dr. Dwi Satya Palipi, S.Si, M.Si  
Universitas Gadjah Mada, 2021. Diumumkan di situs http://etd.repository.ugm.ac.id/

2.2.4 Entropi Standard Boltzmann-Gibbs.....	21
2.2.5 Entropi Shannon.....	22
2.3 Teori Peluang.....	26
2.3.1 Teori Ukuran.....	33
2.3.2 Peubah Acak (Random Variable).....	35
2.3.3 Proses Stokastik.....	36
2.3.4 Proses Markov.....	37
2.4 Proses Difusi.....	39
2.5 Pasar Keuangan.....	40
2.6 Pasar Saham.....	42
2.7 Analisis Variabel di Pasar Saham.....	45
<b>III ENTROPI DAN INDEKS SAHAM</b>	<b>47</b>
3.1 Hubungan Entropi Boltzmann-Gibbs dengan Entropi Shannon.....	47
3.2 Perumusan Modifikasi Entropi Boltzmann-Gibbs Gayut Waktu.....	50
3.2.1. Perhitungan Return Logaritma Natural.....	51
3.2.2. Perhitungan Dengan Menggunakan Teknik Jendela Geser.....	52
3.3 Teori Analisa Grafik.....	53
<b>IV ANALISIS HASIL PERHITUNGAN ENTROPI TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM</b>	<b>55</b>
4.1 Deskripsi Data Penelitian.....	55
4.2 Analisis Hasil Perhitungan.....	62
4.3 Keadaan Entropi saat Krisis Keuangan Global.....	94
<b>V PENUTUP</b>	<b>99</b>
5.1 Kesimpulan.....	99
5.2 Saran.....	100
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	<b>101</b>
<b>LAMPIRAN</b>	<b>104</b>