

## DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	iii
NASKAH SOAL TUGAS AKHIR.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
UCAPAN TERIMAKASIH.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
INTISARI.....	xv
ABSTRACT.....	xvi
BAB I – PENDAHULUAN.....	1
1.1    Latar Belakang.....	1
1.2    Rumusan Masalah.....	5
1.3    Asumsi dan Batasan.....	5
1.4    Tujuan Penelitian.....	6
1.5    Manfaat Penelitian.....	7
BAB II – TINJAUAN PUSTAKA.....	8
BAB III – LANDASAN TEORI.....	15
3.1    Pasar Modal dan Saham.....	15
3.2    Analisis Teknikal.....	16
3.3    Analisis Deret Waktu ( <i>Time Series Analysis</i> ).....	17
3.3.1    Identifikasi karakteristik data.....	18
3.3.2 <i>Moving Average</i> .....	19
3.3.3 <i>Exponential Smoothing</i> .....	20
3.4    Indikator <i>Akaike Information Criterion</i> (AIC).....	20
3.5    Algoritma <i>Neural Network</i> (NN).....	21
3.5.1 <i>Multilayer Feed Forward Network</i> (MLF).....	22
3.5.2 <i>Generalized Regression Neural Network</i> (GRNN).....	23
3.6    Metrik Evaluasi Kinerja Metode Peramalan.....	24
3.7 <i>Software</i> Palisade DecisionTools Suite versi 8.1.1.....	26
BAB IV – METODOLOGI PENELITIAN.....	34

4.1	Objek Penelitian .....	34
4.2	Data Penelitian .....	34
4.3	Alat Penelitian.....	35
4.4	Tahapan Penelitian .....	36
4.4.1	Identifikasi dan perumusan masalah .....	36
4.4.2	Studi literatur .....	36
4.4.3	Pengambilan data historis saham.....	36
4.4.4	Identifikasi karakteristik dan pola data .....	37
4.4.5	Pemodelan dan peramalan harga saham metode <i>distribution fitting</i> (DF) pada @RISK.....	37
4.4.6	Pemodelan dan peramalan harga saham metode <i>moving average</i> (MA) dan <i>exponential smoothing</i> (ES) pada StatTools.....	40
4.4.7	Pemodelan dan peramalan harga saham metode <i>neural network</i> (NN) pada NeuralTools .....	49
4.4.8	Evaluasi kinerja metode peramalan .....	52
4.4.9	Hasil dan pembahasan .....	54
4.4.10	Kesimpulan dan saran.....	54
BAB V – HASIL DAN PEMBAHASAN .....		55
5.1	Karakteristik dan Pola Data.....	55
5.2	Prediksi dengan Metode <i>Distribution Fitting</i> pada @RISK .....	62
5.3	Prediksi dengan Metode <i>Moving Average</i> pada StatTools.....	65
5.4	Prediksi dengan Metode <i>Exponential Smoothing</i> pada StatTools ...	69
5.5	Prediksi dengan Metode <i>Neural Network</i> pada NeuralTools.....	73
5.6	Analisis Akurasi Peramalan Model.....	74
BAB VI – PENUTUP .....		78
6.1	Kesimpulan .....	78
6.2	Saran.....	79
DAFTAR PUSTAKA .....		81
LAMPIRAN.....		89