

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Batasan Masalah.....	3
1.3 Tujuan Penelitian.....	3
1.4 Tinjauan Pustaka	3
1.5 Metode Penelitian.....	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1 Peramalan Runtun Waktu.....	7
2.2 Model Nonlinear	9
2.3 Autoregressive (AR)	9
2.3.1 Stasioneritas Proses Autoregressive.....	10
2.3.2 Estimasi Model Autoregressive	12
2.3.3 Penentuan lag	15
2.4 Jaringan saraf tiruan	15
2.4.1 Arsitektur jaringan	16
2.4.2 Time lagged	18
2.4.3 Fungsi aktivasi	20
2.4.4 Algoritma Pelatihan	22
2.5 Saham	23
2.6 Ukuran Unjuk Kerja Peramalan	26
BAB III NARNET DAN NARXNET	28

3.1	Jaringan Autoregresif Non-linear (NARNET)	28
3.2	Jaringan Autoregresif Non-linear dengan input Eksogen (NARXNET) 29	
3.3	Penentuan jumlah <i>nodes</i>	31
3.4	Algoritma Levenberg-Marquardt	32
3.4.1	Pelatihan Algoritma LM	34
3.4.2	Diagram Alir Pelatihan <i>Levenberg Marquardt</i>	38
3.5	Prosedur Penelitian	41
BAB IV STUDI KASUS		43
4.1	Pengumpulan Data	43
4.1.1	Data harga penutupan saham	43
4.1.2	Indikator teknikal analisis	44
4.2	Persiapan Data	45
4.2.1	Pengecekan <i>outlier</i>	45
4.2.2	Normalisasi data	46
4.2.3	Pengujian Linearitas	46
4.3	Pengembangan Model	47
4.3.1	Kombinasi teknikal indikator	47
4.3.2	Splitting Data	47
4.3.3	Inisiasi <i>node</i>	48
4.3.4	Inisiasi model AR, NARNET dan NARXNET	49
4.4	Pengujian Model	50
4.5	Hasil Pengujian Model	50
4.5.1	Autoregressive (AR)	50
4.5.2	Nonlinear Autoregressive (NARNET)	51
4.5.3	Nonlinear Autoregressive with Exogenous Variable (NARXNET) 52	
4.6	Perbandingan Performa Metode	54
4.7	Penerapan	55
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		57
5.1	Kesimpulan	57
5.2	Saran	57
DAFTAR PUSTAKA		58
LAMPIRAN		61