

**ANALISIS PREDIKSI INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN
(IHSG) MENGGUNAKAN METODE *NONLINEAR AUTO-
REGRESSIVE EXOGENOUS MODEL* (NARX) *NEURAL
NETWORK* DAN METODE *LONG SHORT-TERM MEMORY*
(LSTM)**

Untuk memenuhi sebagian persyaratan
Mencapai derajat Sarjana S-2

Program Studi Magister Manajemen



diajukan oleh:

Baginda Hamzah
21/484056/PEK/27248

Kepada
FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS
UNIVERSITAS GADJAH MADA
2023

**ANALISIS PREDIKSI INDEKS HARGA SAHAM
GABUNGAN (IHSG) MENGGUNAKAN METODE
NONLINEAR AUTO-REGRESSIVE EXOGENOUS
MODEL (NARX) NEURAL NETWORK DAN METODE
LONG SHORT-TERM MEMORY (LSTM)**

yang dipersiapkan dan disusun oleh
Baginda Hamzah
21/484056/PEK/27248
telah dipertahankan di depan Dewan Penguji
pada tanggal 24 Januari 2023
dan dinyatakan telah lulus memenuhi syarat

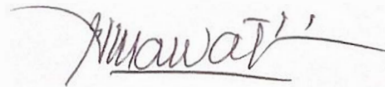
Yogyakarta, 24 Januari 2023

Dosen Penguji I



Agus Setiawan, Dr., M.Soc.Sc.,

Dosen Penguji II



Sukmawati Sukamulja, Prof., Dr.

Dosen Penguji III/Pembimbing



Jogiyanto Hartono M, Prof., Dr., MBA., Ak., CMA., CA.,

PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS atau KARYA TULIS MANDIRI

Yang bertanda tangan di bawah ini saya, menyatakan bahwa tesis/karya tulis mandiri dengan judul:

**ANALISIS PREDIKSI INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN (IHSG) MENGGUNAKAN METODE
NONLINEAR AUTO-REGRESSIVE EXOGENOUS MODEL (NARX) NEURAL NETWORK DAN
METODE LONG SHORT-TERM MEMORY (LSTM)**

dan diajukan untuk diuji pada tanggal: 24 Januari 2023 adalah hasil karya saya. Dengan ini saya menyatakan dengan sesungguhnya bahwa dalam tesis/karya tulis mandiri ini tidak terdapat keseluruhan atau sebagian tulisan orang lain yang saya ambil dengan cara menyalin, atau meniru dalam bentuk rangkaian kalimat atau simbol yang menunjukkan gagasan atau pendapat atau pemikiran dari penulis lain, yang saya aku seolah-olah sebagai tulisan saya sendiri, dan atau tidak terdapat bagian atau keseluruhan tulisan yang saya salin, tiru, atau yang saya ambil dari tulisan orang lain tanpa memberikan pengakuan pada penulis aslinya.

Apabila saya melakukan hal tersebut di atas, baik sengaja atau tidak, dengan ini saya menyatakan menarik tesis/karya tulis mandiri yang saya ajukan sebagai hasil tulisan saya sendiri ini. Bila kemudian terbukti bahwa saya ternyata melakukan tindakan menyalin atau meniru tulisan orang lain seolah-olah hasil pemikiran saya sendiri, berarti gelar dan ijasah yang telah diberikan oleh universitas **batal saya terima**.

Yogyakarta, 24 Januari 2023
Yang Memberi Pernyataan



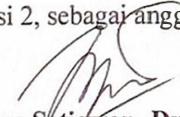
Baginda Hamzah

Saksi 1, sebagai pembimbing tesis/ karya tulis mandiri merangkap anggota tim penguji tesis /karya tulis mandiri:



Jogyanto Hartono M, Prof., Dr., MBA., Ak., CMA., CA.,

Saksi 2, sebagai anggota tim penguji tesis /karya tulis mandiri :



Agus Setiawan, Dr., M.Soc.Sc.,

Saksi 3, sebagai anggota tim penguji tesis /karya tulis mandiri :



Sukmawati Sukamulja, Prof., Dr.