

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iv
HALAMAN MOTTO	vi
PRAKATA.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
INTISARI.....	xv
ABSTRACT.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian	6
1.4. Batasan Masalah.....	7
1.5. Manfaat Penelitian	7
1.6. Sistematika Penulisan.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
BAB III LANDASAN TEORI.....	13
3.1. Gerak Brown	13
3.2. Pasar keuangan.....	14
3.2.1 Saham.....	15
3.2.2 Opsi	16
3.3. Persamaan Black-Scholes.....	17
3.3.1 Persamaan Black-Scholes dengan Proses Stokastik.....	17
3.4. Metode perhitungan Black-Scholes termodifikasi	21
3.5. Metode machine learning	23
3.5.1 Taksonomi dalam Machine Learning	23
3.5.2 Artificial Neural Network.....	25

3.6. Window dan Horizon	28
3.7. Hyperparameter Tuning	29
BAB IV METODE PENELITIAN	30
4.1 Bahan	30
4.2 Alat.....	30
4.3 Tahapan Penelitian	31
4.4 Langkah Komputasi	32
4.4.1 Pra-pemrosesan data.....	33
4.4.2 Perhitungan nilai Black Scholes	38
4.4.2.1 Rincian perhitungan Black-Scholes.....	40
4.4.3 Pemodelan ANN	51
4.4.3.1 Saham sektor alat berat dan sektor bank.....	51
4.4.4 Evaluasi dan validasi model	55
BAB V HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	56
5.1 Sektor alat berat & sektor bank	56
5.3 Indeks saham.....	65
5.4 Analisa hasil.....	66
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN.....	72
6.1 Kesimpulan	72
6.2 Saran	72
DAFTAR PUSTAKA	73
LAMPIRAN.....	77