

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
INTISARI	xiv
ABSTRACT	xv
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	3
1.3. Batasan Masalah	3
1.4. Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
1.4.1. Tujuan Penelitian	4
1.4.2. Manfaat Penelitian	4
1.5. Tinjauan Pustaka	4
1.6. Metodologi Penelitian	6
1.7. Sistematika Penulisan	6
II LANDASAN TEORI	8
2.1. Saham	8
2.1.1. Keuntungan dan Risiko Membeli Saham	8
2.1.2. Jenis-Jenis Saham	9
2.1.3. <i>Return</i> Saham	10
2.2. Perdagangan Saham	11
2.2.1. Pasar Modal	11
2.2.2. Bursa Efek Indonesia (BEI)	11
2.2.3. Pelaku-Pelaku Perdagangan Saham	13
2.2.4. Mekanisme Perdagangan Saham	14
2.2.5. Pasar Perdana dan Pasar Sekunder	15
2.2.6. Indeks Harga Saham	15

2.2.7.	Istilah-Istilah dalam Perdagangan Saham	16
2.2.8.	Sektor-Sektor Saham di Bursa Efek Indonesia	17
2.3.	<i>Machine Learning</i>	19
2.3.1.	Jenis-jenis <i>Machine Learning</i>	19
2.3.2.	<i>Cross Validation</i>	20
2.3.3.	<i>Underfitting</i> dan <i>Overfitting</i>	21
2.3.4.	<i>Hyperparameter</i>	23
2.4.	Peramalan atau <i>Forecasting</i>	24
2.5.	Deret Waktu (<i>Time Series</i>)	27
2.5.1.	Komponen <i>Time Series</i> (Deret Waktu)	28
2.6.	Ukuran Kesalahan Peramalan	29
III	MODEL <i>PROPHET</i>	32
3.1.	Model <i>Prophet</i>	32
3.2.	Persamaan Model <i>Prophet</i>	33
3.2.1.	Tren (<i>Trend</i>)	34
3.2.2.	Musiman (<i>Seasonality</i>)	35
3.2.3.	Hari Libur (<i>Holidays and Events</i>)	36
3.3.	<i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	36
3.3.1.	Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	37
3.3.2.	Autokovarian, Autokorelasi, dan Parsial Autokorelasi	38
3.3.3.	Proses <i>Autoregressive</i> (AR)	40
3.3.4.	Proses <i>Moving Average</i> (MA)	41
3.3.5.	Proses Gabungan <i>Autoregressive</i> dan <i>Moving Average</i> (AR-MA)	42
3.3.6.	Proses <i>Integrated</i> (Stasioner dan Nonstasioner)	43
3.3.7.	Metodologi Box-Jenkins	46
IV	STUDI KASUS	48
4.1.	Deskripsi Data	48
4.2.	Analisis Data	50
4.3.	Pembagian Data	52
4.4.	Pembentukan Model	53
4.5.	Hasil Peramalan	57
4.5.1.	Model <i>Prophet</i>	58
4.5.2.	Model ARIMA	67
4.6.	Pemilihan Model Terbaik	70
4.7.	Forecast dengan Data 3 Bulan	71

4.7.1. Model Prophet	71
4.7.2. Model ARIMA	75
4.7.3. Hasil Akhir Uji	76
V PENUTUP	77
5.1. Kesimpulan	77
5.2. Saran	78
DAFTAR PUSTAKA	82