

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMBANG	xiii
INTISARI	xv
ABSTRACT	xvi
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.3. Tinjauan Pustaka	3
1.4. Metodologi Penelitian	5
1.5. Sistematika Penulisan	6
II Dasar Teori	7
2.1. Teori Probabilitas	7
2.2. Proses Stokastik	9
2.3. Mean dan Variansi	9
2.3.1. Mean	10
2.3.2. Variansi	10
2.4. Regresi Linear Sederhana	11
2.5. Data Runtun Waktu	17
2.6. Eksponen Hurst	19
2.7. Gerakan Brownian (<i>Brownian Motion</i>)	20
2.8. <i>Fractional Brownian Motion</i>	20
2.9. <i>Self Similarity</i>	25
2.10. <i>Long-term Memory</i>	27
2.11. Geometri Fraktal	28
2.12. <i>Box Dimension</i> (Dimensi Kotak)	31

2.13. <i>Fractional Noise</i>	32
2.14. Efek Joseph	33
2.15. Garis Tren (<i>Trendline</i>)	34
2.16. LQ45	35
III Analisis <i>Rescaled Range</i>	38
3.1. Hubungan antara Dimensi Fraktal dan Eksponen Hurst	40
3.2. Karakteristik Data runtun waktu	42
3.2.1. Antipersisten	42
3.2.2. <i>Random Walk</i>	43
3.2.3. Persisten	43
3.3. Contoh Analisis	43
3.3.1. Data yang Persisten	43
3.3.2. Data yang Antipersisten	46
3.3.3. Data yang <i>Random Walk</i>	49
3.4. Kestabilan Hasil Analisis <i>Rescaled Range</i>	52
IV Hasil dan Interpretasi	53
4.1. Hasil Analisis	53
4.2. Interpretasi Hasil	58
4.3. Validasi Empiris terhadap Sifat Persisten	59
V Kesimpulan	64
DAFTAR PUSTAKA	66
A SKRIP PROGRAM PHYTON ANALISIS RESCALED RANGE	68
B SKRIP PROGRAM METODE ANALISIS GARIS TREN	71