

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Lembar Pengesahan	ii
Pernyataan Bebas Plagiasi	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	ix
Daftar Gambar.....	xi
Daftar Lampiran	xiv
Daftar Singkatan.....	xv
Intisari	xvi
<i>Abstract</i>	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Motivasi Penelitian	8
1.7 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	8
1.8 Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI DAN KAJIAN PUSTAKA	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 <i>Long Short-Term Memory (LSTM)</i>	11
2.1.2 <i>Efficient Market Hypothesis (EMH)</i>	12
2.1.3 Prediksi Harga Saham Menggunakan Kecerdasan Buatan (<i>AI</i>).....	14
2.1.4 <i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i> untuk Evaluasi <i>Forecasting</i>	15
2.1.5 <i>Mean Absolute Error (MAE)</i> untuk Evaluasi <i>Forecasting</i>	15
2.2 Tinjauan Pustaka	16
2.2.1 Prediksi Harga Saham dan Efisiensi Pasar.....	16
2.2.2 <i>Artificial Intelligence</i> dalam Prediksi Harga Saham	17

2.2.3 <i>Long Short-Term Memory (LSTM)</i> dalam Peramalan Pasar Saham	18
2.2.4 Indikator Teknikal dan Evaluasi Kinerja Model	19
2.2.5 Prediksi Harga Saham Lintas Pasar dan Frekuensi Tinggi	19
2.3 Kesenjangan Penelitian	20
BAB III METODE PENELITIAN	21
3.1 Desain Penelitian.....	21
3.2 Sampel.....	21
3.3 Instrumen Penelitian.....	23
3.4 Teknik Pengumpulan Data	23
3.5 Teknik Analisis Data	24
3.5.1 <i>Data Preprocessing</i>	24
3.5.2 <i>LSTM Modelling</i>	24
3.5.3 Prediksi dan Evaluasi hasil prediksi.....	25
3.6 Definisi Operasional Variabel	25
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	27
4.1 Akurasi model <i>AI-LSTM</i> dalam memprediksi harga saham <i>intraday</i> pada emiten di ASEAN-5 menggunakan harga historis saham sebagai input.....	27
4.1.1 Akurasi model <i>AI-LSTM</i> untuk prediksi <i>Open, High, Low, dan Close Price</i> menggunakan input harga historis pada emiten indeks LQ45 di IDX	27
4.1.2 Akurasi model <i>AI-LSTM</i> untuk prediksi <i>Open, High, Low, dan Close Price</i> menggunakan input harga historis pada emiten indeks FTSE BURSA MALAYSIA KLCI di BMSB.....	33
4.1.3 Akurasi model <i>AI-LSTM</i> untuk prediksi <i>Open, High, Low, dan Close Price</i> menggunakan input harga historis pada emiten indeks FTSE STI di SGX	40
4.1.4 Akurasi model <i>AI-LSTM</i> untuk prediksi <i>Open, High, Low, dan Close Price</i> menggunakan input harga historis pada emiten indeks PSEi di PSE..	45
4.1.5 Akurasi model <i>AI-LSTM</i> untuk prediksi <i>Open, High, Low, dan Close Price</i> menggunakan input harga historis pada emiten indeks SET50 di SET51	
4.2 Perbandingan akurasi model <i>AI-LSTM</i> dalam memprediksi harga saham <i>intraday</i> pada emiten indeks LQ45 di IDX dengan dua skenario input.....	57
4.3 Perbandingan akurasi model <i>AI-LSTM</i> dalam memprediksi harga saham <i>intraday</i> pada emiten indeks FTSE BURSA MALAYSIA KLCI di BMSB dengan dua skenario input	61
4.4 Perbandingan akurasi model <i>AI-LSTM</i> dalam memprediksi harga saham <i>intraday</i> pada emiten indeks FTSE STI di SGX dengan dua skenario input....	65
4.5 Perbandingan akurasi model <i>AI-LSTM</i> dalam memprediksi harga saham <i>intraday</i> pada emiten indeks PSEi di PSE dengan dua skenario input	68
4.6 Perbandingan akurasi model <i>AI-LSTM</i> dalam memprediksi harga saham <i>intraday</i> pada emiten indeks SET50 di SET dengan dua skenario input.....	71



BAB V KESIMPULAN.....	75
5.1 Simpulan	75
5.2 Implikasi.....	77
5.3 Keterbatasan Penelitian.....	78
5.4 Saran.....	78
 Daftar Pustaka	 80
Lampiran	83