UNIVERSITAS
GADJAH MADA
OPTIMISASI PORTOFOLIO BERBASIS PREDICT-THEN-OPTIMIZE DENGAN MACHINE LEARNING DAN ENTROPY DINAMIS PADA INDEKS KOMPAS100
MUHAMMAD FADHIL ABDUL BAATSITH, Prof. Dr. Jogiyanto Hartono M M.B.A., Ak., CMA., CA.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR ISI

PRAKATA ..... **iii**

DAFTAR ISI ..... **vi**

DAFTAR TABEL ..... **viii**

DAFTAR GAMBAR ..... **ix**

INTISARI ..... **x**

ABSTRACT ..... **xi**

BAB I PENDAHULUAN **1**

1.1 Latar Belakang 1
1.2 Rumusan Masalah 5
1.3 Pertanyaan Penelitian 7
1.4 Tujuan Penelitian 8
1.5 Manfaat Penelitian 8
1.6 Lingkup Penelitian 9
1.7 Sistematika Penulisan 10

BAB II LANDASAN TEORI **12**

2.1 Kerangka Dasar Optimisasi Portofolio 12
2.2 Dimensi Fitur Prediktif, Teknikal, Makroekonomi dan Fundamental 15
2.3 *Machine Learning* dalam Prediksi Pasar Keuangan 21
2.4 *Predict-Then-Optimize* (PrTO) 22
2.5 Fungsi Reduksi Risiko dan Pendorong Multiaset *(Regularizer)* 23
2.6 Mitigasi Penularan Krisis (*Contagion*) dengan *Transfer Entropy* 25
2.7 Validasi Kelayakan *Investibility* dengan Restriksi Evaluasi *Turnover* 29
2.8 Matrik Evaluasi Kinerja dan Risiko Porfotolio 32
2.9 Kajian Penelitian Terdahulu 37

BAB III METODA PENELITIAN **40**

3.1 Desain Penelitian 40
3.2 Metoda Pengumpulan Data 42

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
OPTIMISASI PORTOFOLIO BERBASIS PREDICT-THEN-OPTIMIZE DENGAN MACHINE LEARNING DAN ENTROPY DINAMIS PADA INDEKS KOMPAS100
MUHAMMAD FADHIL ABDUL BAATSITH, Prof. Dr. Jogiyanto Hartono M M.B.A., Ak., CMA., CA.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

3.3 Diagram Alur Penelitian 43
3.4 Metoda Analisis Data 46
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 52
4.1 Analisis Statistik Deskriptif dan Performa Prediktif 52
4.2 Efektivitas Regulasi Entropy dalam Mitigasi Risiko 58
4.3 Keunggulan Net CAGR model *Adaptive Entropy* 67
BAB V SIMPULAN 75
5.1 Kesimpulan 75
5.2 Implikasi 77
5.3 Keterbatasan 79
5.4 Saran 81
DAFTAR PUSTAKA 82
LAMPIRAN 87