



DAFTAR ISI

| | |
|---|------|
| HALAMAN JUDUL | i |
| HALAMAN PENGESAHAN..... | ii |
| HALAMAN PERNYATAAN | iii |
| HALAMAN PERSEMBAHAN | iv |
| KATA PENGANTAR | v |
| DAFTAR ISI..... | vii |
| DAFTAR TABEL..... | ix |
| DAFTAR GAMBAR | x |
| DAFTAR LAMPIRAN..... | xi |
| INTISARI | xii |
| ABSTRACT..... | xiii |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1. Latar Belakang | 1 |
| 1.2. Pembatasan Masalah | 3 |
| 1.3. Tujuan | 4 |
| 1.4. Tinjauan Pustaka | 4 |
| 1.5. Metode Penelitian | 5 |
| 1.6. Sistematika Penulisan..... | 5 |
| BAB II LANDASAN TEORI..... | 6 |
| 2.1. Data Runtun Waktu Keuangan | 6 |
| 2.1.1. Saham dan pasar modal..... | 6 |
| 2.1.2. Analisis harga saham..... | 8 |
| 2.2. <i>Event Study</i> | 9 |
| 2.3. Uji Kolmogorov-Smirnov | 12 |
| 2.4. Regresi Linear Sederhana | 12 |
| 2.5. Uji <i>t</i> | 13 |
| 2.6. <i>Mean Squared Error</i> | 14 |
| 2.7. <i>Training Error</i> | 15 |
| 2.8. Matriks..... | 15 |
| 2.9. Program Kuadratik (<i>Quadratic Programming</i>) | 16 |
| 2.10. Pengali Lagrange | 18 |
| 2.11. Karush Kuhn Tucker (KKT)..... | 18 |
| 2.12. <i>Machine Learning</i> | 19 |



| | |
|--|----|
| 2.13. Support Vector Machine..... | 20 |
| 2.14. Estimasi Parameter Fungsi..... | 25 |
| 2.14.1. <i>Sequential Minimal Optimization</i> | 25 |
| 2.14.2 Menghitung nilai parameter b | 30 |
| BAB III e-SVR dan v-SVR..... | 32 |
| 3.1. Pengertian <i>Support Vector Regression</i> | 32 |
| 3.2. e-SVR | 33 |
| 3.3. v-SVR | 37 |
| 3.4. Metode Kernel | 40 |
| 3.4.1. Kernel RBF Gaussian..... | 42 |
| 3.4.2. Kernel Laplacian | 42 |
| 3.4.3. Kernel Anova | 43 |
| 3.4.4. Kernel Bessel | 43 |
| 3.5. SMO untuk v-SVR..... | 43 |
| 3.6. Algoritma SVR..... | 47 |
| BAB IV STUDI KASUS | 48 |
| 4.1. Deskripsi Data | 48 |
| 4.2. Deskripsi Studi Kasus..... | 50 |
| 4.3. Analisis Deskriptif | 51 |
| 4.4. <i>Event Study</i> Peristiwa Pemilu 2014 | 52 |
| 4.5. Pemodelan IHSG dengan SVR..... | 54 |
| 4.5.1. Model SVR dengan Kernel Gaussian..... | 55 |
| 4.5.2. Model SVR dengan Kernel Laplacian | 55 |
| 4.5.3. Model SVR dengan Kernel Anova..... | 56 |
| 4.5.4. Model SVR dengan Kernel Bessel..... | 57 |
| 4.6. Pemilihan Model Terbaik Setiap Jenis SVR..... | 57 |
| 4.6.1. Model terbaik e-SVR | 58 |
| 4.6.2. Model terbaik v-SVR | 61 |
| 4.7. Pemilihan Model SVR terbaik..... | 63 |
| BAB V PENUTUP | 67 |
| 5.1. Kesimpulan | 67 |
| 5.2. Saran | 67 |
| DAFTAR PUSTAKA | 69 |
| LAMPIRAN..... | 71 |