

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	i
PERNYATAAN	ii
HALAMAN MOTTO	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
PRAKATA	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
ABSTRAKSI	xiii
ABSTRACT	xiv
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Batasan Masalah	3
1.4 Tujuan Penelitian	3
1.5 Manfaat Penelitian	3
1.6 Sistematika Penulisan	4
II TINJAUAN PUSTAKA	6
III LANDASAN TEORI	11
3.1 Pasar Modal	11
3.2 Saham	11
3.2.1 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	14

3.2.2	Sektor Saham	15
3.2.3	<i>Return</i> Saham	16
3.3	<i>Preprocessing</i>	17
3.4	Koefisien Korelasi	17
3.5	<i>P-value</i>	18
3.6	<i>Pearson Correlation Coefficient</i>	18
3.7	<i>Partial Correlation Coefficient</i>	19
3.8	<i>Kendall's Tau Correlation Coefficient</i>	19
3.9	Algoritme Kruskal	20
3.10	<i>Minimum Spanning Tree</i>	21
3.11	<i>Community Detection</i>	22
3.12	Algoritme Leiden	22
3.13	<i>Adjusted Mutual Information</i>	22
3.14	<i>Adjusted Rand Index</i>	25
IV	ANALISIS DAN PERANCANGAN	26
4.1	Analisis Sistem	26
4.2	Tahapan Penelitian	27
4.3	Rancangan Pengambilan Data	29
4.3.1	Data IPO BEI	29
4.3.2	Yahoo Finance	29
4.3.3	Data Sektor Saham	31
4.4	Rancangan Algoritme	31
4.4.1	Pengumpulan Data Awal	31
4.4.2	<i>Preprocessing</i>	32
4.4.3	Pembagian <i>Dataset</i>	36
4.4.4	Pembuatan Komunitas Saham	36
4.4.5	Rancangan Pengujian	38
V	IMPLEMENTASI	39
5.1	Spesifikasi Sistem	39
5.2	Implementasi Pengumpulan Data	40
5.2.1	Data IPO BEI	40
5.2.2	Yahoo Finance	40
5.2.3	Data Sektor Saham	42
5.3	Implementasi <i>Preprocessing</i>	42

5.3.1	Penghapusan Data yang Tidak Digunakan	44
5.3.2	Pengisian Data yang Kosong	44
5.3.3	Normalisasi Data menjadi <i>log return</i>	45
5.3.4	Penghapusan Data <i>log return</i> yang Tidak Akurat	46
5.3.5	Menghapus Data Saham yang Stagnan	46
5.4	Implementasi Pembagian <i>Dataset</i>	47
5.5	Implementasi Pembuatan Komunitas Saham	47
5.5.1	Implementasi Pembuatan Bobot Jarak	48
5.5.2	Implementasi Pembuatan Topologi Jaringan	50
5.5.3	Implementasi Pembuatan Komunitas	52
5.5.4	Implementasi Penghitungan Performa	52
VI	HASIL DAN PEMBAHASAN	54
6.1	Proses Pengumpulan Data	54
6.1.1	Data IPO BEI	54
6.1.2	Data <i>Yahoo Finance</i>	54
6.1.3	Data Sektor Saham	55
6.2	Hasil <i>Preprocessing</i>	55
6.3	Hasil Pembuatan Komunitas	56
6.3.1	Hasil Pembobotan Jarak	56
6.3.2	Hasil Pembuatan Topologi Jaringan	56
6.3.3	Hasil Pembuatan Komunitas Saham	58
6.4	Hasil Penghitungan Performa	58
6.4.1	Hasil Penghitungan Performa AMI	59
6.4.2	Hasil Penghitungan Performa ARI	60
VII	KESIMPULAN DAN SARAN	62
7.1	Kesimpulan	62
7.2	Saran	63
	DAFTAR PUSTAKA	64
	LAMPIRAN	68