

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.1.1 Bursa Efek Indonesia (BEI)	1
1.1.2 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	2
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	5
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.5.1 Aspek Akademis	7
1.5.2 Aspek Praktis	7
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	7
BAB II	9
TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Teori – Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu	9
2.1.1 Pasar Modal	9
2.1.2 Indeks Harga Saham Gabungan	10
2.1.3 Ilmu Ekonomi	10
2.1.4 Ekonomi Makro	10
2.1.4.1 Suku Bunga	11
2.1.4.2 Inflasi	11

2.1.4.3	Uang Beredar (M2)	12
2.1.4.4	Nilai Tukar	12
2.1.5	<i>Machine Learning</i>	13
2.1.6	ARIMA	14
2.1.7	LSTM	15
2.1.8	<i>Artificial Neural Network</i>	15
2.1.9	Kajian Penelitian Terdahulu	18
2.2	Kerangka Pemikiran	23
BAB III		25
METODE PENELITIAN		25
3.1	Jenis Penelitian	25
3.2	Operasionalisasi Variabel	26
3.3	Tahapan Penelitian	28
3.4	Populasi dan Sampel/Situasi Sosial	30
3.4.1	Populasi	30
3.4.2	Sampel	30
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data	31
3.6	Teknik Analisis Data	31
3.6.1	<i>Exploratory Data Analysis</i>	31
3.6.2	<i>Data Preprocessing</i>	31
3.6.3	<i>Modeling</i>	33
3.6.4	<i>Forecasting</i>	33
BAB IV		35
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		35
4.1	Data Deskriptif	35
4.2	Hasil Penelitian	36
4.2.1	<i>Exploratory Data Analysis</i>	36
4.2.2	<i>Data Preprocessing</i>	39
4.2.3	<i>Modeling</i>	41
4.2.4	<i>Forecasting</i>	44
4.3	Pembahasan Penelitian	46
4.3.1	Waktu Terbaik Untuk Prediksi	46

4.3.2	Kombinasi Model ARIMA, LSTM, dan ANN Dalam Prediksi....	46
4.3.3	Hasil Prediksi Model ARIMA, LSTM, dan ANN.....	47
4.3.3.1	Hasil ARIMA.....	48
4.3.3.2	Hasil LSTM	49
4.3.3.3	Hasil ANN	50
4.3.3.4	Hasil Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan	52
BAB V		55
KESIMPULAN DAN SARAN		55
5.1	Kesimpulan	55
5.2	Saran.....	55
5.2.1	Saran Akademisi.....	56
5.2.2	Saran Praktisi.....	56
DAFTAR PUSTAKA		57
LAMPIRAN.....		59