

## DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN .....	v
KATA PENGANTAR .....	vi
ABSTRAK .....	viii
ABSTRACT .....	ix
DAFTAR ISI .....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR .....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2. Latar Belakang.....	4
1.3. Perumusan Masalah.....	10
1.4. Pertanyaan Penelitian .....	11
1.5. Tujuan Penelitian.....	12
1.6. Manfaat Penelitian.....	12
1.6.1. Manfaat akademis .....	12
1.6.2. Manfaat praktis .....	12
1.7. Ruang Lingkup Penelitian .....	12
1.8. Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	13
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	15
2.1. Teori-Teori Terkait Penelitian.....	15
2.1.1. Teori Investasi.....	15
2.1.2. Saham.....	17
2.1.3. Portofolio .....	18

2.1.4.	Diversifikasi .....	18
2.1.5.	Optimasi Portofolio .....	19
2.1.6.	<i>Big Data</i> .....	20
2.1.7.	<i>Data Mining</i> .....	21
2.1.8.	Prediksi .....	22
2.1.9.	<i>Artificial Neural Network</i> .....	23
2.1.10.	<i>Genetic Algorithm</i> .....	27
2.2.	Penelitian Terdahulu .....	30
2.3.	Kerangka Pemikiran .....	35
BAB III METODE PENELITIAN .....		37
3.1.	Karakteristik Penelitian .....	37
3.2.	Alat Pengumpulan Data .....	37
3.3.	Tahapan Penelitian .....	39
3.4.	Populasi dan Sampel .....	40
3.4.1.	Populasi .....	40
3.4.2.	Sampel .....	40
3.5.	Pengumpulan Data dan Sumber Data .....	43
3.6.	Teknik Analisis Data .....	44
3.6.1.	<i>Pre-processing</i> .....	44
3.6.2.	Prediksi Nilai Saham Masa Depan dengan ANN .....	45
3.6.3.	Pengukuran Akurasi Prediksi dengan Rasio <i>error</i> .....	47
3.6.4.	<i>Single Index Model</i> Portofolio Optimal .....	48
3.6.5.	Pengoptimisasian Portofolio Model Indeks Tunggal dengan <i>Genetic Algorithm</i> .....	52
3.6.6.	Membandingkan Model Indeks Tunggal dan <i>Genetic Algorithm</i> .....	54
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....		55
4.1.	Prediksi Harga Saham Masa Depan dengan <i>Artificial Neural Network</i> .....	55

4.2.	Tingkat Akurasi prediksi yang dihasilkan oleh <i>Artificial Neural Network</i> .....	58
4.3.	Pembentukan Portofolio dengan <i>Single Index Model</i> .....	61
4.4.	Pembentukan Portofolio dengan <i>Genetic Algorithm</i> .....	65
4.5.	Perbandingan Portofolio Hasil Optimisasi dengan Portofolio Indeks LQ45 .....	69
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		70
5.1.	Kesimpulan.....	71
5.2.	Saran .....	72
DAFTAR PUSTAKA .....		73