

DAFTAR ISI

	<i>Hal</i>
LEMBAR PENGESAHAN	<i>i</i>
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	<i>ii</i>
HALAMAN PERSETUJUAN PUBLIKASI	<i>iii</i>
RIWAYAT HIDUP	<i>iv</i>
ABSTRAK	<i>v</i>
ABSTRACT	<i>vi</i>
KATA PENGANTAR	<i>vii</i>
DAFTAR ISI	<i>x</i>
DAFTAR GAMBAR	<i>xii</i>
DAFTAR TABEL	<i>xiii</i>
DAFTAR LAMPIRAN	<i>xiv</i>
BAB I. PENDAHULUAN	<i>1</i>
1.1 Latar Belakang	<i>1</i>
1.2 Identifikasi Masalah	<i>4</i>
1.3 Batasan Masalah	<i>4</i>
1.4 Rumusan Masalah	<i>5</i>
1.5 Tujuan Penelitian	<i>5</i>
1.6 Manfaat Penelitian	<i>6</i>
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA	<i>7</i>
2.1 Investasi	<i>7</i>
2.2 Pasar Modal	<i>7</i>
2.3 Saham	<i>8</i>
2.4 Harga Saham	<i>9</i>
2.5 Ekonofisika	<i>13</i>
2.6 Teori Kinetik Gas	<i>15</i>
2.7 Geometric Brownian Motion (GBM)	<i>17</i>
2.8 Deep learning	<i>22</i>
2.7.1 Long Short-Term Memory (LSTM)	<i>22</i>
2.7.2 Hyperparameter	<i>29</i>
BAB III. METODE PENELITIAN	<i>32</i>

3.1	Lokasi dan Waktu Penelitian.....	32
3.2	Jenis Penelitian	32
3.3	Teknik Pengumpulan Data	32
3.4	Prosedur Penelitian	33
3.4.1	Pengumpulan Data	33
3.4.2	<i>Pre-processing</i> Data.....	34
3.4.3	LSTM.....	35
3.4.4.1	<i>Split Data</i>	35
3.4.4.2	Pembuatan Model LSTM.....	35
3.4.4	<i>Geometric Brownian Motion</i> (GBM).....	36
3.4.4.1	Hitung Nilai Return	36
3.4.4.2	Estimasi Parameter.....	36
3.4.4.3	Simulasi Prediksi	37
3.5	Evaluasi Performa Model.....	37
3.5.1	<i>Root Mean Square Error</i> (RMSE).....	37
3.5.2	<i>Mean Absolute Error</i> (MAE)	37
3.5.3	<i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE).....	38
3.5.4	Koefisien Determinasi (R^2).....	38
3.6	Alat Pendukung.....	39
3.7	Diagram Alir	40
BAB IV.	HASIL DAN PEMBAHASAN	42
4.1	Hasil Prediksi dengan <i>Long Short-Term Memory</i> (LSTM)	42
4.1.1	Hasil Prediksi variasi <i>Epoch</i> LSTM.....	44
4.1.2	Hasil Prediksi variasi <i>Batch size</i> LSTM	47
4.1.3	Hasil Prediksi kombinasi <i>Epoch</i> dan <i>Batch size</i> LSTM.....	49
4.2	Hasil Prediksi variasi iterasi <i>Geometric Brownian Motion</i> (GBM)..	54
4.3	Perbandingan Jenis <i>Hyperparameter</i>	57
4.4	Hasil Prediksi Saham BBKA dan BBRI	60
BAB V.	PENUTUP.....	62
5.1	Kesimpulan	62
5.2	Saran	63
DAFTAR PUSTAKA		64
LAMPIRAN		69