



DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL	
DAFTAR GAMBAR	
DAFTAR LAMPIRAN	
DAFTAR SINGKATAN	
DAFTAR ISTILAH	
1 PENDAHULUAN	1
Latar Belakang	1
Perumusan Masalah	2
Tujuan Penelitian	2
Manfaat Penelitian	3
Ruang Lingkup Penelitian	3
2 TINJAUAN PUSTAKA	3
Investasi	3
Portofolio	4
<i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	5
<i>Data Mining</i>	6
<i>Association Rule Mining (ARM)</i>	7
Penelitian Terdahulu	11
Kerangka Pemikiran	13
3 METODE	15
Pendekatan Penelitian	15
Jenis dan Sumber Data	15
Teknik Pengolahan dan Analisis Data	16
4 HASIL DAN PEMBAHASAN	22
Pembentukan CAPM Secara Langsung	22
Pembentukan Portofolio Menggunakan CAPM+ARM	25
Perbedaan Hasil CAPM dengan CAPM+ARM	33
Implikasi Manajerial	34
5 SIMPULAN DAN SARAN	35
Simpulan	35
Saran	36
DAFTAR PUSTAKA	37
LAMPIRAN	41
RIWAYAT HIDUP	47

Hak cipta dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IPB, tahun 2015



Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

MB-IPB

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang menggunakan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



DAFTAR TABEL

1	Contoh market basket transaction (Tan <i>et al.</i> 2006)	8
2	Penyimpanan data secara normalisasi	9
3	Penelitian terdahulu	12
4	Daftar tabel emiten	15
5	Astra Agro Lestari Tbk. (AALI)	17
6	SMART Tbk. (SMAR)	17
7	PT. Sampoerna Agro Tbk. (SGRO)	17
8	Return Astra Agro Lestari Tbk. (AALI)	18
9	Return SMART Tbk. (SMAR)	18
10	Return PT. Sampoerna Agro Tbk. (SGRO)	18
11	Association rule friendly data set	19
12	Pemangkasan data dengan <i>minimum support</i> 75%	20
13	Hasil perhitungan portofolio menggunakan CAPM	22
14	Hasil perhitungan nilai <i>support</i> 1-itemset	26
15	Hasil perhitungan nilai <i>support</i> 2-itemset	28
16	Hasil perhitungan nilai <i>support</i> 3-itemset	29
17	Hasil perhitungan nilai <i>confidence</i>	29
18	Hasil perhitungan portofolio CAPM+ARM	31
19	Perbandingan CAPM dengan CAPM+ARM	34

DAFTAR GAMBAR

1	Tahap-tahap proses KDD (Mabrur & Lubis, 2012)	6
2	Antimonotonic dalam pewarisan <i>frequent itemsets generation</i> (Tan <i>et al.</i> 2006)	9
3	Apriori principle dengan batasan <i>minimum support</i> = 3 (Tan <i>et al.</i> 2006)	10
4	Kerangka pemikiran	14
5	(a) Grafik SML semua emiten, (b) Grafik SML tanpa emiten DSFI	24
6	Perbandingan <i>Minimum support</i> terhadap lama proses waktu (t) seleksi	25
7	(a) Grafik SML menggunakan CAPM tanpa emiten saham DSFI dan MLBI, (b) Grafik SML menggunakan CAPM+ARM dengan proses seleksi 1-itemset	31
8	Grafik SML dengan menggunakan proses seleksi	32
9	(a) Aturan saham AALI, (b) Aturan saham UNVR, (c) Aturan saham HMSP, (d) Aturan saham MYOR, (e) Aturan saham GGRM, (f) Aturan saham INDF, (g) Aturan saham SGRO, (h) Aturan saham ULTJ	32

DAFTAR LAMPIRAN

1	Hasil seleksi 1-itemset, <i>minimum support</i> 10%	41
2	Hasil seleksi 2-itemset, <i>minimum support</i> 10%	41
3	Hasil seleksi 3-itemset, <i>minimum support</i> 10%	41
4	Hasil seleksi 4-itemset, <i>minimum support</i> 10%	42

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.

2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.

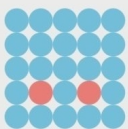


DAFTAR LAMPIRAN (lanjutan)

5	Hasil nilai <i>confidence</i> , <i>minimum support</i> 10%	42
6	Aturan saham, <i>minimum support</i> 10%	42
7	Hasil seleksi 1- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 15%	43
8	Hasil seleksi 2- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 15%	43
9	Hasil seleksi 3- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 15%	43
10	Hasil seleksi 4- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 15%	43
11	Hasil nilai <i>confidence</i> , <i>minimum support</i> 15%	44
12	Aturan saham, <i>minimum support</i> 15%	44
13	Hasil seleksi 1- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 25%	45
14	Hasil seleksi 2- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 25%	45
15	Hasil seleksi 3- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 25%	45
16	Hasil nilai <i>confidence</i> , <i>minimum support</i> 25%	45
17	Aturan saham, <i>minimum support</i> 25%	46
18	Hasil seleksi 1- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 30%	46
19	Hasil seleksi 2- <i>itemset</i> , <i>minimum support</i> 30%	46

© Hak cipta milik IPB, tahun 2015

Hak cipta dilindungi Undang-Undang



MB-IPB
Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.

2. Dilarang menggunakan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



HAK CIPTA
AALI
ADES
AISA
ARM
BISI
BTEK
CAPM
CEKA
CPRO
DAVO
DLTA
DSFI
FASW
GGRM
GZCO
HMSP
IHKP
INDF
INKP
INRU
MLBI
MYOR
PSDN
RMBA
SGRO
SIPD
SKLT
SMAR
SPMA
STTP
SULI
TBLA
TIRT
TKIM
ULTJ
UNSP
UNVR

© Hak cipta milik IPB, tahun 2015

MB-IPB
Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

DAFTAR SINGKATAN

PT. Astra Agro Lestari Tbk
PT Akasha Wira International Tbk
Tiga Pilar Sejahtera Food Tbk.
Association Rule Mining
BISI International Tbk.
PT. Bumi Teknokultura Unggul Tbk
Capital Asset Pricing Model
PT Cahaya Kalbar Tbk
Central Proteinaprima Tbk
PT Davomas Abadi Tbk
Delta Djakarta Tbk.
PT. Dharma Samudera Fishing Industries Tbk
Fajar Surya Wisesa Tbk.
Gudang Garam Tbk
Gozco Plantations Tbk.
Handjaya Mandala Sampoerna Tbk
PT. Inti Agro Resources Tbk
Indofood Sukses Makmur Tbk.
Indah Kiat Pulp & paper Tbk
Toba Pulp Lestari Tbk
Multi Bintang Indonesia Tbk.
Mayor Indah Tbk.
Prasidha Aneka Niaga Tbk
Bentoel International Investama Tbk
PT. Sampoerna Agro Tbk
Sierad Produce Tbk.
Sekar Laut Tbk.
PT. Sinar Mas Agro Resources and Technology Tbk
Suparma Tbk.
Siantar Top Tbk.
Sumalindo Lestari Jaya Tbk
Tunas Baru Lampung Tbk.
Tirta Mahakam Resources Tbk
Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk.
Ultra Jaya Milk Industry & Trad
Bakrie Sumatra Plantations Tbk.
Unilever Indonesia Tbk.

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.

2. Dilarang menggunakan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



Hak cipta dilindungi Undang-Undang

<i>Apriori</i>	Algoritma untuk menghasilkan suatu pola
<i>Association rule mining</i>	Salah satu metode yang terdapat di teknik <i>data mining</i>
<i>Beta</i>	Resiko yang berasal dari hubung antara <i>return</i> suatu saham dengan <i>return</i> pasar
<i>Capital asset pricing model</i>	Hasil utama dari ekonomi keuangan modern, yang memberikan prediksi yang tepat antara hubungan resiko sebuah aset dan tingkat kembalian
<i>Confidence value</i>	Nilai keyakinan
<i>Data collection</i>	Pengumpulan data
<i>Data mining</i>	Pengetahuan dari data yang sangat besar sehingga menghasilkan informasi yang berguna
<i>Data preprocessing</i>	Proses awal pengolahan data, proses ini berfungsi untuk menghilangkan duplikasi data
<i>Frequent itemset generation</i>	Bagian pertama dari aturan ARM yang merupakan satu set <i>item</i> yang sering muncul dalam data transaksi
<i>Minimum confidence value</i>	Batas nilai keyakinan
<i>Minimum support value</i>	Batas nilai dukungan
<i>Support value</i>	Nilai dukungan

© Hak cipta milik IPB, tahun 2015

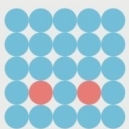
DAFTAR ISTILAH

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.

2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



MB-IPB
Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor