

ABSTRAKSI

IDX High Dividen 20 (IDXHIDIV20) merupakan indeks baru yang dikeluarkan oleh Bursa Efek Indonesia (BEI) pada 2018, indeks ini sangat cocok bagi investor pemula dikarenakan selalu membagikan dividennya setiap tahun. Analisis teknikal diharapkan dapat membantu mengetahui pola-pola pergerakan harga saham dimasa yang akan datang.

Tujuan penelitian ini adalah membangun model prediksi dari *Artificial Neural Network* (ANN) *Backpropagation* dan melakukan perhitungan tingkat akurasi serta evaluasi menggunakan *Mean Square Error* (MSE), *Mean Absolute Error* (MAE) dan *R Square* (R^2).

TensorFlow dan *Keras* sebagai *Deep Learning Framework* serta *Technical Indicator* yakni *Accumulation Distribution Oscillator* (ADOSC), *Commodity Channel Index* (CCI), *Larry William R%* (WILLR), *Momentum* (MOM), *Rate of Change* (ROC), *Relative Strength Index* (RSI), *Simple Moving Average* (SMA), *Moving Average* (MA), *Weighted Moving Average* (WMA) digunakan sebagai *variable input*.

Open, *High*, *Low*, *Close* dan *Volume* dari emiten BBCA, BBRI, HMSP, TLKM dan UNVR selama 10 tahun (Januari 2009 - Desember 2018) digunakan untuk membangun model menggunakan *Artificial Neural Network* (ANN) *Backpropagation*.

Model dengan *hidden layer* 32-32-1 yang menggunakan *Stochastic Gradient Descent* (SGD) 0.01 dan *No Batch Normalization* merupakan model terbaik dalam penelitian ini.

Kata Kunci: Artificial Neural Network , Backpropagation, Harga Saham, Prediksi