

Abstrak

Prediksi nilai saham adalah isu yang sangat penting di dunia keuangan. Saat ini jaringan syaraf tiruan (JST) telah begitu populer digunakan dalam masalah-masalah keuangan seperti prediksi indeks nilai saham, prediksi kepailitan, dan klasifikasi obligasi perusahaan. Jaringan Syaraf Tiruan adalah sebuah model komputer dimana arsitekturnya adalah meniru kemampuan belajar dari otak manusia. Elemen proses dari sebuah JST meyerupai struktur biologi dari sel-sel syaraf dan operasi internal dalam otak manusia. Dalam tugas akhir ini, kami memfokuskan pada penggunaan data historis dan beberapa indikator pasar untuk memperkirakan nilai di masa akan datang sebagai fungsi dari nilai masa lampau dalam memprediksikan nilai saham (per emiten) pada Bursa Efek Jakarta (BEJ). Kami menerapkan teknik modifikasi nilai hasil fungsi yang didesain untuk melakukan perubahan historis account pada hubungan input-output. Algoritma training yang digunakan adalah Propagasi Balik standar dengan momentum masa. Penggunaan modifikasi hasil fungsi didasarkan pada dua teori pasar yaitu The Random Walk Hyphotesis dan The Efficient Market Hyphotesis. Kedua teori tersebut meyakini bahwa harga (nilai) dari saham bergerak dengan perilaku yang acak dan tak terduga.

Hasil pengujian menunjukkan bahwa jaringan yang menggunakan modified returns function akan menghasilkan tingkat akurasi prediksi yang lebih baik daripada jaringan yang hanya menggunakan fungsi diferensiasi variabel relatif standar.

Kata kunci: Prediksi, Nilai Saham, Jaringan Syaraf, BEJ, Hasil Fungsi.