

Abstrak

Indeks Saham Gabungan adalah suatu index yang terdiri dari stocks (saham-saham) pilihan yang didaftarkan di sebuah bursa yang di hitung berdasarkan *Market Capitalization* atau *Price Weighted*. Index ini berlaku sebagai suatu indikator atau barometer dari kesehatan perekonomian suatu negara secara umum. Dengan demikian, suatu kontrak berjangka yang berbasiskan index tersebut memungkinkan seorang investor untuk membeli / menjual suatu ukuran kontrak yang tetap (*fixed*) dari index tersebut pada harga sekarang untuk tanggal penyelesaian yang akan datang.

Dalam tugas akhir ini digunakan metode *Backpropagation Bayesian Regularization* untuk memodelkan arsitektur JST, yang mana arsitektur ini akan digunakan untuk memprediksi nilai saham pada suatu periode waktu tertentu.

Data yang digunakan untuk training, testing dan predicting yaitu *Dow-Jones Industrial Average (DJIA) closing values from 1900 to 1992*.

Dari hasil pengujian didapatkan model arsitektur JST *Backpropagation Bayesian Regularization* lebih akurat dan cepat dibandingkan JST *Backpropagation Adaptive Learning Rate*.

Kata kunci : *training, testing, predicting, Backpropagation Bayesian Regularization, Backpropagation Adaptive Learning Rate, Learning rate, Levenberg-Marquardt (MU)*.