

Pendekatan Artificial Neural Network Metode Backpropagation dalam Pemodelan Pergerakan Harga Saham: Studi pada Kemampuan Ketepatan Memprediksi Pergerakan Saham-Saham Indeks LQ45 Menggunakan Artificial Neural Network

Arief Purnama L.K., author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=136174&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan dari tesis ini adalah untuk berkontribusi dalam pengembangan sistem kecerdasan buatan (artificial intelligence) untuk memodelkan pergerakan saham yang bersifat tidak linier dan penuh ketidakpastian. Pendekatan yang digunakan adalah model Artificial Neural Network (ANN) metode Backpropagation. Sebagai pembanding, digunakan model multivariate ARIMA. Penelitian akan membuktikan bahwa model ANN dapat lebih tepat memprediksi pergerakan harga saham di Indonesia, khususnya saham-saham anggota indeks LQ45, dibandingkan model multivariate ARIMA. Penelitian ini adalah penelitian observasi model. Penelitian menghasilkan kesimpulan bahwa model ANN signifikan secara statistik lebih akurat daripada model multivariate ARIMA.

<hr>The objective of this thesis is to contribute the development of artificial intelligence system in modeling stock price movement which highly non-linear and uncertain in nature. Our approach is using Artificial Neural Network (ANN) with Backpropagation method. In comparing the accuracy of the model, we use multivariate ARIMA method. This research intend to show that ANN model is more accurate in predicting Indonesian stock price movement, especially LQ45 index, compared to multivariate ARIMA model. This research is using observational method in selecting the best model. The result of the research is that ANN is statistically significant and more accurate compared to multivariate ARIMA model.