

Abstrak

Pasar saham diharapkan dapat mengumpulkan uang dari masyarakat untuk membangun dan meningkatkan pendapatan masyarakat. Masyarakat yang menjadi investor utama dalam pasar saham dapat mengetahui dan mengerti dalam analisis penanaman saham lebih banyak sehingga dapat memberikan keuntungan yang paling optimal. Salah satu pendekatan untuk mengevaluasi penanaman saham dengan menggunakan analisis teknikal yang menggunakan data atau catatan dari sebuah pasar yang diterbitkan koran, majalah atau internet, contohnya nilai saham, volume perdagangan dan faktor lain yang mempengaruhi nilai saham secara teknis maka diperlukan peramalan saham yang digunakan untuk acuan broker.

Tujuan penelitian ini untuk membangun sebuah sistem berdasarkan Self-Organizing Maps(SOM) untuk mengetahui peramalan pada esok hari juga untuk mengetahui algoritma pelatihan yang tepat. Alasan pemilihan SOM, khususnya peramalan nilai saham karena algoritma *Self – Organizing Maps* lebih baik karena ketepatannya dalam mengklasifikasi kasus pada saat *training set* dan *test set*. Self-Organizing Maps dengan algoritma pelatihan sekuensial dan *batch* yang digunakan untuk membentuk pola yang menjadi *output* dari pelatihan SOM. Hasil dari penelitian menunjukkan akurasi peramalan untuk esok hari selama sebulan sebesar 77.5 % dengan *error rate* 0.01%-1%.

Kata kunci: sekuensial, *Batch*, *Self-Organizing Maps*, analisis teknikal.