

Abstrak

Belakangan ini perkembangan saham mengalami peningkatan yang pesat. Hal ini dikarenakan saham memiliki nilai bisnis yang tinggi untuk mendapatkan keuntungan. Di sisi lain saham juga mempunyai resiko relatif tinggi jika dibandingkan dengan jenis investasi atau instrumen surat berharga. Pembuatan saham ini diharapkan dapat membantu para investor dalam pengambilan keputusan. Dengan sistem ini, Para Investor dapat mengetahui nilai harga saham 1 hari kedepan. Dengan demikian, para investor dapat melakukan langkah-langkah antisipasi di masa mendatang.

Pada tugas akhir ini dikembangkan suatu sistem peramalan nilai harga saham yang berdasarkan data historis (time series) nilai harga saham dengan menggunakan Metode gabungan Jaringan Syaraf Tiruan Backpropagation dan Algoritma Genetika. Pada permasalahan peramalan saham, Algoritma Genetika digunakan untuk membangun berbagai variasi arsitektur jaringan saraf tiruan, dan Backpropagation untuk melatih arsitektur jaringan saraf tiruan.

Data yang digunakan dalam pembangunan sistem ini adalah data historis(time series) milik perusahaan DOWJONES dari tahun 1985 sampai tahun 2002.

Kata kunci : Jaringan Syaraf Tiruan, Algoritma Genetika, data *time series*.