

ABSTRAK

Pasar efisien menyiratkan harga semua sekuritas yang diperdagangkan mencerminkan semua informasi yang tersedia sehingga informasi menjadi parameter utama yang digunakan untuk membuat keputusan investasi yang tepat. Informasi pada pasar modal dapat digunakan untuk membuat strategi investasi, menentukan nilai harga saham pada masa depan dan pembentukan portofolio. Liptan 6 memberitakan mengenai rusaknya satelit I Telkom pada Agustus 2017 dan menjadi sebuah catatan buruk bagi Telkom dan beberapa saham perbankan, sehingga menyebabkan saham Telkom turun sebesar 1.15%. Seiring perkembangan waktu menyebabkan peredaran informasi menjadi lebih cepat, sehingga mempengaruhi jumlah variasi informasi yang direspon cepat oleh investor. Dengan menggunakan analisa konvensional tentunya membutuhkan waktu yang lama serta kurang efisien. Kehadiran *Big Data* dipercaya dapat menyelesaikan berbagai permasalahan yang ada dengan cepat, menyelesaikan data rumit dan jumlah data yang banyak.

Tujuan dari penelitian ini adalah pertama melakukan pemetaan terhadap sentiment investor yang terdapat pada LQ-45, kedua menentukan model klasifikasi yang lebih tepat untuk *sentiment analysis*, ketiga menemukan tingkat kekuatan hubungan antara isu dengan harga saham dan keempat menentukan dinamika harga saham akibat isu. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah pertama dengan *sentiment analysis* untuk menganalisa isu pada pasar modal menggunakan klasifikasi *Support Vector Machine* dan *Naïve Bayes*, kedua, uji koefisien korelasi *rank spearman* dan ketiga adalah *scatter plot diagram*.

Hasil dari penelitian ini adalah pertama, kinerja LQ-45 selama tahun 2017 didominasi oleh kinerja positif sehingga 81% opini positif dan 63% dipengaruhi oleh isu mikro, kedua setelah melakukan pengujian dengan menggunakan model klasifikasi *sentiment Support Vector Machine (SVM)* dan *Naïve Bayes (NBC)* menghasilkan model klasifikasi *SVM* lebih *fit* untuk melakukan processing data sentiment dengan nilai akurasi 78.01%, KAPPA 10%, Presisi 62%, Recall 52.33% dan F-measure 56.75%, ketiga nilai korelasi *rank spearman* yaitu sebesar 0.07 atau 7% yang berarti nilai tersebut tergolong lemah dan keempat tidak ada perubahan pola signifikan yang dapat dilihat pada persebaran pola pada *scatter plot*.

Kata Kunci : Pasar Efisien, *Sentiment Analysis*, Korelasi *Rank Spearman*, *Naïve Bayes Classifier*, *Support Vector Machine*