

# Prediksi Harga Saham di Indonesia dengan Metode Convolutional Neural Network

Disa Marhamah Arrafi<sup>1</sup>, Imelda Atastina<sup>2</sup>

<sup>1,2,3</sup>Fakultas Informatika, Universitas Telkom, Bandung

<sup>1</sup>[disamarhamah@students.telkomuniversity.ac.id](mailto:disamarhamah@students.telkomuniversity.ac.id),

<sup>2</sup>[imelda@telkomuniversity.ac.id](mailto:imelda@telkomuniversity.ac.id),

---

## Abstrak

Saham adalah tanda penyertaan atau kepemilikan seseorang atau badan dalam suatu perusahaan. Nilai harga saham dapat diperoleh dari banyak faktor, karena banyak perubahan pada faktor tersebut, harga saham dapat naik atau turun. Prediksi harga saham telah banyak dilakukan oleh peneliti lain dengan tingkat akurasi yang berbeda beda. Dalam penelitian ini, akan mngembangkan sistem prediksi menggunakan metode CNN – LSTM. Dataset tersebut berisi data saham JKSE, AALI, ABMM, AISA, dan SMBR yang diharapkan dapat menghasilkan strategi pembelajaran terbaik dengan berbagai eksperimen yang telah ditentukan. Hasil eksperimen menunjukkan bahwa arsitektur yang teroptimal menggunakan fungsi aktivasi TANH, dengan jumlah neuron pada lapisan CNN yaitu 32 dan 64, jumlah lapisan LSTM 50 dan 100, serta nilai epoch 20 dan 100.

**Kata kunci:** CNN – LSTM, Deep Learning, Harga saham

---

