

Prediksi Pergerakan Saham Menggunakan Support Vector Regression dan Long Short-Term Memory

Nova Monica Sarumpaet¹, Indwiarti², Aniq Atiqi Rohmawati³

^{1,2,3}Fakultas Informatika, Universitas Telkom, Bandung

¹novasarumpaet@student.telkomuniversity.ac.id, ²indwiarti@telkomuniversity.ac.id,

³aniqatiqi@telkomuniversity.ac.id

Abstrak

Prediksi saham merupakan salah satu solusi yang menarik didunia komputasi. Prediksi saham memiliki peran yang penting dalam menentukan pola pergerakan suatu harga saham dari waktu ke waktu. Keberhasilan prediksi harga saham merupakan keuntungan bagi seorang investor untuk dapat menentukan waktu yang tepat untuk membeli maupun menjual saham. Dalam penelitian ini menggunakan Support Vector Regression dan Long Short-Term Memory untuk memprediksi harga saham dengan menggunakan dataset Nasdaq. Dari penelitian yang telah dilakukan dapat disimpulkan bahwa Long Short-Term Memory memiliki hasil prediksi yang lebih baik dibandingkan dengan Support Vector Regression dengan nilai RMSE sebesar 192.6, MAE sebesar 144.12, dan R-Squared sebesar 0.9941. Hasil tersebut menunjukkan prediksi yang bagus karena model mampu memberikan nilai eror yang kecil dan nilai R-Squared yang besar.

Kata kunci : prediksi saham, SVR, LSTM, Nasdaq
