

Abstrak - Investasi saham sudah populer di kalangan masyarakat. Walaupun investasi saham ini memiliki resiko yang cukup besar, setiap tahunnya investor terus bertambah karena return dari saham juga cukup menjanjikan, ditambah dengan kehadiran media sosial yang dapat memberikan informasi secara luas dan cepat sehingga dapat mempengaruhi pergerakan harga saham. Teori Efficient Market Hypothesis (EMH) mendefinisikan bahwa informasi pada pasar menggambarkan harga saham. Pada penelitian ini, dilakukan analisis sentimen dari dataset yang diambil pada twitter yang bertujuan mengolah sentimen menjadi informasi yang bermanfaat. Semua tweet berkaitan dengan harga saham dikumpulkan untuk dilakukan analisis berdasarkan tipe sentimen yang sesuai, baik itu sentimen positif maupun negatif. Sentimen ini dipercaya memiliki pengaruh terhadap pergerakan harga saham. Proses analisis sentimen ini menggunakan metode hybrid yaitu Convolutional Neural Network (CNN) dan Bidirectional Long Short-Term Memory (Bi-LSTM) dengan ekspansi fitur Word2Vec, setelah itu dilakukan analisis menggunakan metode hybrid tersebut untuk disimpulkan akurasi akhir yang didapatkan. Penelitian ini menggunakan 27.930 data dan menunjukkan hasil hybrid CNN Bi-LSTM mencapai 95.74%

Kata kunci: convolutional neural network, analisis sentimen, bidirectional long short-term memory, Twitter, saham