

1. Pendahuluan

Di pasar saham saat ini, pendapat positif dan negatif merupakan indikator penting dari pergerakan harga saham. Seiring dengan itu, perkembangan internet dan jejaring sosial memungkinkan pengguna media sosial untuk mengungkapkan pendapat dan berbagi pandangan mereka tentang pergerakan harga saham di pasar saham.

Analisis sentimen terhadap harga saham di Twitter saat ini menjadi topik penelitian yang sedang dibahas; sebuah studi yang dilakukan oleh Hong Keel Sul, Alan R Dennis, dan Lingyao Yuan menemukan bahwa hubungan antara sentimen tweet dari suatu perusahaan dan pergerakan harga saham perusahaan memiliki pengaruh [1].

PT Bank Central Asia Tbk (BCA) merupakan salah satu pemain besar di industri perbankan Indonesia [2]. Pada tanggal 1 Agustus 2022, layanan perbankan mobile BCA atau M-banking mengalami gangguan, sehingga banyak nasabah mengalami masalah dalam melakukan aktivitas mereka. Akibat insiden ini, pengguna media sosial dan nasabah bank BCA memberikan sentimen negatif kepada Bank BCA [3]. Dapat dikutip dari cuitan salah satu nasabah akun Twitter atas nama pengguna @SuciIndahYani5 "mbanking bca lagi perlu perlunya malah error gajelas bgt". Dari cuitan tersebut, pendapat yang diungkapkan oleh akun @SuciIndahYani5 menunjukkan bahwa layanan perbankan mengalami kesalahan dan telah mengecewakan banyak nasabah lainnya. Insiden kesalahan ini menciptakan sentimen negatif yang cukup besar terhadap Bank BCA.

Berdasarkan masalah-masalah ini, para peneliti akan menemukan korelasi antara analisis sentimen dan harga saham bank BCA. Peneliti akan mengambil dan mengumpulkan data cuitan dari Twitter mengenai kesalahan dalam layanan bank BCA pada Januari 2019 hingga Februari 2023. Pengambilan data dari Januari 2019 hingga Februari 2023 dilakukan agar penulis mendapatkan wawasan lebih tentang kenaikan saham BBKA beberapa tahun yang lalu. Dengan data yang terkumpul, peneliti akan melakukan tahap analisis sentimen untuk menghasilkan sentimen berharga guna menentukan tingkat kepuasan nasabah bank BCA. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah yang terbaik dalam penelitian terkait analisis sentimen sebelumnya.

Studi ini terkait analisis sentimen untuk model dasar deep learning terbaik menurut penelitian [4] adalah model GRU dan akan menggunakan model deep learning hibrida dengan menggabungkan model Convolutional Neural Network (CNN) dengan Gated Recurrent Unit (GRU) karena menurut penelitian yang dilakukan [5], model deep learning hibrida CNN-GRU mendapatkan nilai F1-score terbaik. Dalam penelitian analisis sentimen di Twitter tentang pergerakan saham BBKA menggunakan model CNN-GRU dan ekspansi fitur GloVe, diharapkan dapat membantu investor dalam membuat keputusan untuk membeli saham.