

## ABSTRAK

Prediksi pergerakan harga saham merupakan topik yang menarik dan penting dalam analisis pasar keuangan karena kemampuan untuk memahami dan memprediksi tren harga dapat memberikan keuntungan strategis bagi investor. Penelitian ini bertujuan untuk menjawab apakah penambahan fitur fundamental perusahaan seperti Price-to-Earnings (PE), Price-to-Book Value (PBV), dan Debt-to-Equity Ratio (DER) dapat memberikan hasil yang lebih baik dibandingkan dengan hanya menggunakan data historis berupa harga saham penutupan (Close) dalam memprediksi pergerakan harga saham mingguan. Data yang digunakan dalam penelitian ini diambil dari Bursa Efek Indonesia (BEI), dengan fokus pada harga penutupan (Close) sebagai fitur utamanya. Untuk mendukung analisis, fitur Close juga dilengkapi dengan model ARMA (Autoregressive Moving Average) dan ARIMA (Autoregressive Integrated Moving Average) untuk menangkap pola temporal dalam data historis. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah Temporal Convolutional Network (TCN), dengan klasifikasi harga saham menjadi tiga kategori, yaitu naik, stagnan, dan turun, berdasarkan perubahan harga saham dengan ambang batas 1%, 2%, dan 3%. Studi ini menunjukkan bahwa ambang batas 3 merupakan yang terbaik untuk memprediksi pergerakan harga saham jangka pendek (mingguan). Akan tetapi, penambahan data fundamental tidak menghasilkan kinerja yang lebih baik daripada hanya menggunakan data historis. Akurasi rata-rata dan F1-Score dengan data historis mencapai 94%.

**Kata Kunci:** prediksi harga saham, TCN, fitur fundamental, ARMA dan ARIMA, analisis deret waktu