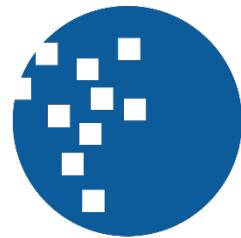


**OPTIMALISASI MODEL PREDIKSI HARGA SAHAM
SEKTOR INFRASTRUKTUR DENGAN ALGORITMA
HIBRIDA CNN-LSTM**



UMN
UNIVERSITAS
MULTIMEDIA
NUSANTARA

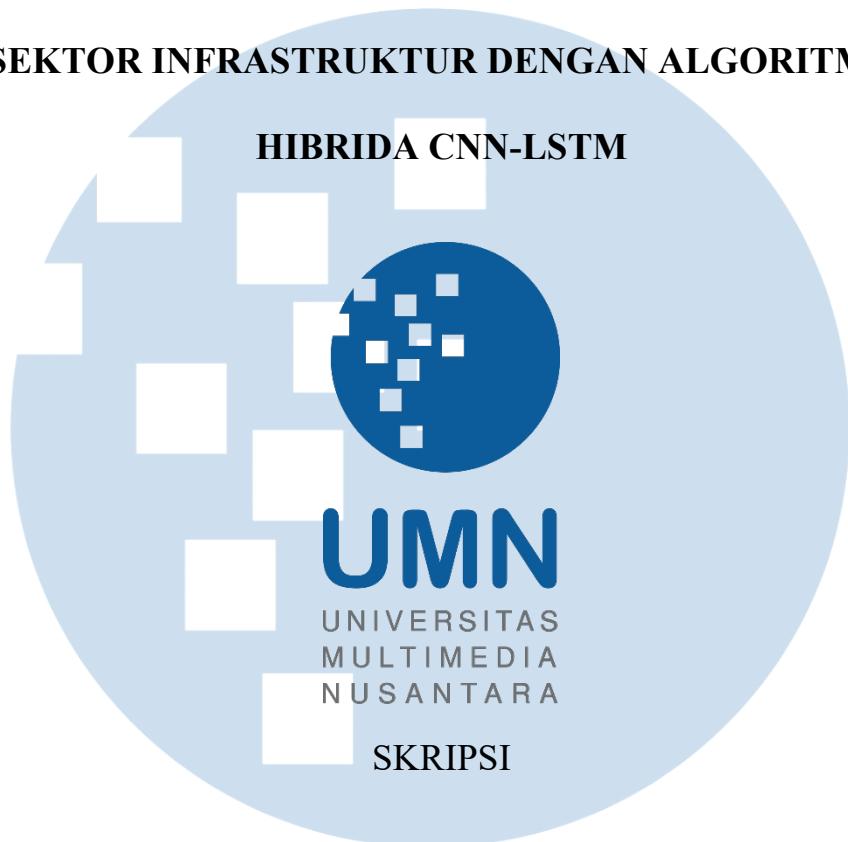
SKRIPSI

Rieva Putri Safa

00000047659

**PROGRAM STUDI SISTEM INFORMASI
FAKULTAS TEKNIK DAN INFORMATIKA
UNIVERSITAS MULTIMEDIA NUSANTARA
TANGERANG
2024**

**OPTIMALISASI MODEL PREDIKSI HARGA SAHAM
SEKTOR INFRASTRUKTUR DENGAN ALGORITMA**



Diajukan sebagai Salah Satu Syarat untuk Memperoleh

Gelar Sarjana Komputer

Rieva Putri Safa

00000047659

PROGRAM STUDI SISTEM INFORMASI
FAKULTAS TEKNIK DAN INFORMATIKA
UNIVERSITAS MULTIMEDIA NUSANTARA
TANGERANG
2024

HALAMAN PERNYATAAN TIDAK PLAGIAT

Dengan ini saya,

Nama : Rieva Putri Safa
Nomor Induk Mahasiswa : 00000047659
Program studi : Sistem Informasi

Skripsi dengan judul:

OPTIMALISASI MODEL PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR INFRASTRUKTUR DENGAN ALGORITMA HIBRIDA CNN-LSTM

merupakan hasil karya saya sendiri bukan plagiat dari karya ilmiah yang ditulis oleh orang lain, dan semua sumber, baik yang dikutip maupun dirujuk, telah saya nyatakan dengan benar serta dicantumkan di Daftar Pustaka.

Jika di kemudian hari terbukti ditemukan kecurangan/penyimpangan, baik dalam pelaksanaan skripsi maupun dalam penulisan laporan skripsi, saya bersedia menerima konsekuensi dinyatakan TIDAK LULUS untuk Tugas Akhir yang telah saya tempuh.

Tangerang, 22 Mei 2024



(Rieva Putri Safa)

HALAMAN PERSETUJUAN

Skripsi dengan judul

OPTIMALISASI MODEL PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR INFRASTRUKTUR DENGAN ALGORITMA HIBRIDA CNN-LSTM

Oleh

Nama : Rieva Putri Safa
NIM : 00000047659
Program Studi : Sistem Informasi
Fakultas : Teknik dan Informatika

Telah disetujui untuk diajukan pada

Sidang Ujian Skripsi Universitas Multimedia Nusantara

Tangerang, 15 Mei 2024

Pembimbing

Ir. Raymond Sunardi Oetama, M.CIS.
328046803

Ketua Program Studi Sistem Informasi

14.05.2024

Ririn Ikana Desanti, S.Kom., M.Kom.
313058001

LEMBAR PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH MAHASISWA

Yang bertanda tangan dibawah ini:

Nama : Rieva Putri Safa
Nomor Induk Mahasiswa : 00000047659
Program Studi : Sistem Informasi
Jenjang : S1
Judul Karya Ilmiah :

“OPTIMALISASI MODEL PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR INFRASTRUKTUR DENGAN ALGORITMA HIBRIDA CNN-LSTM”

Menyatakan dengan sesungguhnya bahwa saya bersedia:

Memberikan izin sepenuhnya kepada Universitas Multimedia Nusantara untuk mempublikasikan hasil karya ilmiah saya di repositori Knowledge Center, sehingga dapat diakses oleh Civitas Akademika/Publik. Saya menyatakan bahwa karya ilmiah yang saya buat tidak mengandung data yang bersifat konfidensial dan saya juga tidak akan mencabut kembali izin yang telah saya berikan dengan alasan apapun.

Saya tidak bersedia, dikarenakan:

Dalam proses pengajuan untuk diterbitkan ke jurnal/konferensi nasional/internasional (dibuktikan dengan *letter of acceptance*) *.

Tangerang, 22 Mei 2024



(Rieva Putri Safa)

* Jika tidak bisa membuktikan LoA jurnal/HKI selama 6 bulan kedepan, saya bersedia mengizinkan penuh karya ilmiah saya untuk diunggah ke KC UMN dan menjadi hak institusi UMN.

KATA PENGANTAR

Puji Syukur kepada Tuhan Yang Maha Esa atas selesainya penulisan Laporan Skripsi ini dengan judul: “Optimalisasi Model Prediksi Harga Saham Sektor Infrastruktur dengan Algoritma Hibrida CNN-LSTM” dilakukan untuk memenuhi salah satu syarat untuk mencapai gelar S.Kom. Jurusan Sistem Informasi Pada Fakultas Teknik dan Informatika Universitas Multimedia Nusantara. Saya menyadari bahwa tanpa bantuan dan bimbingan dari berbagai pihak sangatlah sulit bagi saya untuk menyelesaikan tugas akhir ini. Oleh karena itu, saya mengucapkan terima kasih kepada:

1. Bapak Dr. Ninok Leksono, M.A., selaku Rektor Universitas Multimedia Nusantara.
2. Bapak Dr. Eng. Niki Prastomo, S.T., M.Sc., selaku Dekan Fakultas Teknik dan Informatika Universitas Multimedia Nusantara.
3. Ibu Ririn Ikana Desanti, S.Kom., M.Kom., selaku Ketua Program Studi Sistem Informasi Universitas Multimedia Nusantara.
4. Bapak Ir. Raymond Sunardi Oetama, M.CIS., sebagai Pembimbing yang telah memberikan bimbingan, arahan, dan motivasi atas selama pelaksanaan Skripsi ini.
5. Ibu, mendiang ayah, dan keluarga yang telah menjadi semangat dan motivasi penulis dalam menyelesaikan Skripsi ini.
6. Teman-teman yang telah memberikan masukan, saran, dan dukungan.

Semoga karya ilmiah ini bermanfaat, baik sebagai sumber informasi maupun sumber inspirasi, bagi para pembaca.

UNIVERSITAS
MULTIMEDIA
NUSANTARA

Tangerang, 15 Mei 2024



(Rieva Putri Safa)

OPTIMALISASI MODEL PREDIKSI HARGA SAHAM SEKTOR INFRASTRUKTUR DENGAN ALGORITMA HIBRIDA CNN-LSTM

(Rieva Putri Safa)

ABSTRAK

Tren peningkatan investasi saham di Indonesia menekankan pada saham infrastruktur, sektor pasar modal terpopuler kedua. Analisis saham yang komprehensif diperlukan karena investasi saham dapat menghasilkan untung dan rugi. Oleh karena itu, investor memerlukan pendekatan analitis yang lebih maju untuk menemukan kemungkinan investasi terbaik dan tren pasar. Untuk penyetelan hyperparameter dan optimasi model prediksi harga saham, Grid Search, XGBoost, dan CNN-LSTM hybrid digunakan. Kerangka kerja CRISP-DM dan Python digunakan untuk menganalisis harga saham dari empat bisnis infrastruktur Indonesia. Hasil menunjukkan bahwa model hybrid CNN-LSTM yang menggunakan parameter Grid Search dari kedua model tunggal mengoptimalkan kinerja model tunggal CNN dan LSTM dalam memprediksi empat harga saham infrastruktur, yaitu EXCL.JK, JSMR.JK, TLKM.JK, dan FREN.JK. Pada 3 dari 4 kode saham, model CNN-LSTM memiliki performa terbaik terutama pada EXCL.JK dengan RMSE 0.009199, MSE 8.463e-05, MAE 0.0066978, dan MAPE 0.026313. Model hibrida CNN-LSTM lebih cocok dengan hasil aktual dan antisipasi. Namun, XGBoost mengoptimalkan model tetapi tidak signifikan. Studi ini menemukan bahwa model hybrid CNN-LSTM efektif dalam memprediksi harga saham sektor infrastruktur Indonesia, dengan nilai error yang lebih rendah dibandingkan model tunggal LSTM dan CNN. Model hybrid mengoptimalkan satu model untuk prediksi harga saham yang lebih akurat. Hasil ini menunjukkan bahwa pembelajaran mendalam, khususnya model hibrida, meningkatkan prediksi harga saham.

Kata kunci: CNN-LSTM, Deep Learning, Grid Search, Prediksi Harga Saham, XGBoost

OPTIMIZATION OF INFRASTRUCTURE SECTOR STOCK PRICE PREDICTION MODEL USING CNN-LSTM HYBRID ALGORITHM

(Rieva Putri Safa)

ABSTRACT (English)

Indonesia's rising stock investment trend emphasizes infrastructure shares, the capital market's second most popular sector. Comprehensive stock analysis is necessary since stock investments can yield profits and losses. Therefore, investors need more advanced analytical approaches to find the best investment possibilities and market trends. For hyperparameter tuning and stock price prediction model optimization, Grid Search, XGBoost, and a CNN-LSTM hybrid are utilized. The CRISP-DM framework and Python were used to analyze stock prices from four Indonesian infrastructure companies. Results demonstrate that the CNN-LSTM hybrid model using Grid Search parameters from both single models optimizes CNN and LSTM single model performance in predicting four infrastructure stock prices, namely EXCL.JK, JSMR.JK, TLKM.JK, and FREN.JK. On 3 out of 4 stock code, the CNN-LSTM model performed best especially on EXCL.JK with RMSE 0.009199, MSE 8.463e-05, MAE 0.0066978, and MAPE 0.026313. The CNN-LSTM hybrid model matches actual and anticipated results better. However, XGBoost optimizes model but is insignificant. This study found that the CNN-LSTM hybrid model effectively predicts share prices, with lower error values than the single LSTM and CNN models. Hybrid model optimizes model for more accurate stock price predictions. These results suggest that deep learning, especially hybrid models, improves stock price predictions.

Keywords: CNN-LSTM, Deep Learning, Grid Search, Stock Price Prediction, XGBoost

DAFTAR ISI

HALAMAN PERNYATAAN TIDAK PLAGIAT	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
LEMBAR PERSETUJUAN PUBLIKASI.....	v
KARYA ILMIAH MAHASISWA.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
ABSTRAK	vii
<i>ABSTRACT (English)</i>	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR RUMUS	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Batasan Masalah	6
1.4 Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	7
1.4.1 Tujuan Penelitian	7
1.4.2 Manfaat Penelitian	7
1.5 Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	10
2.1 Penelitian Terdahulu	10
2.2 Tinjauan Teori.....	13
2.2.1 Saham.....	13
2.2.2 <i>Machine Learning</i>	13
2.2.3 <i>Deep Learning</i>	14
2.2.4 <i>Missing Values</i>	15
2.2.5 <i>Hyperparameter Tuning</i>	15
2.2.6 <i>MinMax Scaling</i>	17

4.4.2 Model LSTM	71
4.4.3 Model Ensemble XGBoost.....	74
4.4.4 Model Hibrida CNN-LSTM.....	76
4.5 Tahap <i>Data Evaluation</i>	78
4.5.1 Evaluasi Model Prediksi Kode Saham EXCL.JK.....	80
4.5.2 Evaluasi Model Prediksi Kode Saham JSMR.JK.....	85
4.5.3 Evaluasi Model Prediksi Kode Saham TLKM.JK	89
4.5.4 Evaluasi Model Prediksi Kode Saham FREN.JK.....	94
4.6 Diskusi Hasil Penelitian	99
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	105
5.1 Simpulan.....	105
5.2 Saran	106
DAFTAR PUSTAKA	108



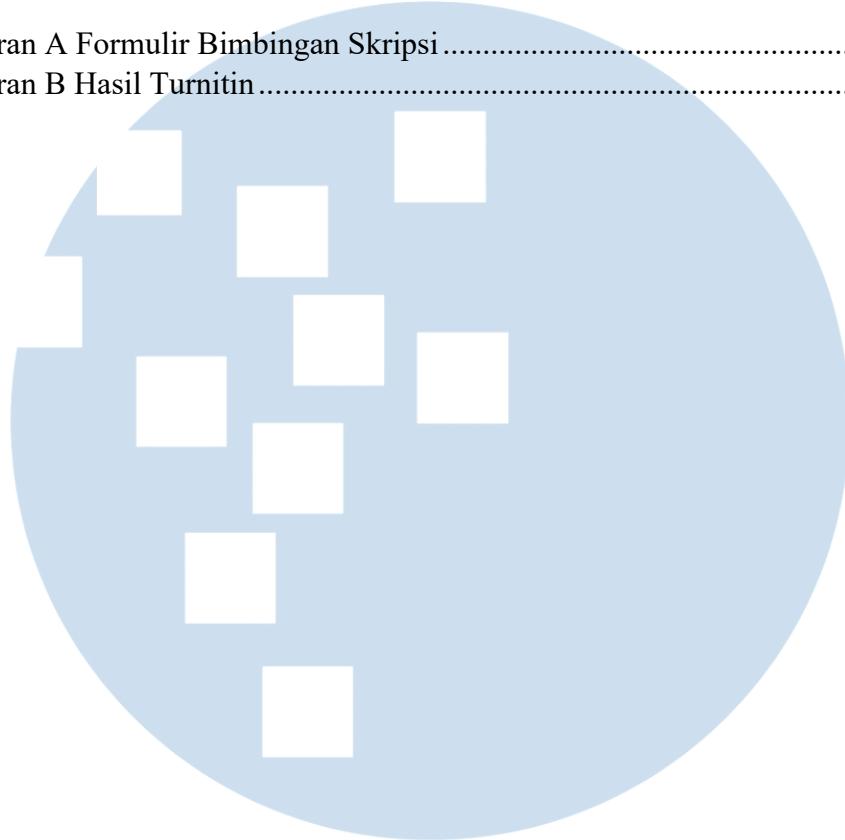
DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	10
Tabel 3. 1 Perbandingan Metode SEMMA, CRISP-DM, dan KDD	41
Tabel 3. 2 Perbandingan LSTM, RNN, ANN	47
Tabel 3. 3 Pemilihan Algoritma CNN.....	48
Tabel 3. 4 Perbandingan Grid Search dengan Random Search	49
Tabel 3. 5 Perbandingan XGBoost dengan LightGBM.	50
Tabel 3. 6 Kode Saham Perusahaan Infrastruktur.....	52
Tabel 3. 7 Perbandingan Bahasa Pemrograman R dan Python.....	54
Tabel 4. 1 Kombinasi Parameter Model CNN pada Manual Tuning.....	68
Tabel 4. 2 Kombinasi Parameter Model CNN dengan GridSearchCV.....	70
Tabel 4. 3 Kombinasi Parameter Model LSTM pada Manual Tuning	72
Tabel 4. 4 Kombinasi Parameter Model LSTM dengan GridSearchCV	74
Tabel 4. 5 Kombinasi Hyperparameter Model Hibrida CNN-LSTM	78
Tabel 4. 6 Hasil Matriks Evaluasi EXCL.JK	82
Tabel 4. 7 Hasil Matriks Evaluasi JSMR.JK.....	87
Tabel 4. 8 Hasil Matriks Evaluasi TLKM.JK	91
Tabel 4. 9 Hasil Matriks Evaluasi FREN.JK	97
Tabel 4. 10 Hasil Performa Model CNN, LSTM, XGBoost, dan CNN-LSTM Berdasarkan Matriks Evaluasi.....	99
Tabel 4. 11 Perbandingan Matriks Evaluasi Terhadap Penelitian Terdahulu....	102



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran A Formulir Bimbingan Skripsi	120
Lampiran B Hasil Turnitin	121



UMN
UNIVERSITAS
MULTIMEDIA
NUSANTARA