

Abstrak

Investasi pada saham belakangan ini menjadi tren di kalangan masyarakat. Masalah yang sering terjadi pada saham adalah sulitnya memprediksi kenaikan atau penurunannya harga saham. Pada Juli 2019, Bank Mandiri mengalami gangguan sistem yang menyebabkan saldo nasabah bertambah atau berkurang secara drastis. Dari kejadian tersebut muncullah berbagai opini pada media sosial dan banyak media berita menyebarkan informasi tersebut. Berdasarkan kejadian tersebut, penulis akan mengembangkan sistem untuk melihat keterkaitan antara sentiment dengan saham suatu perusahaan. Pada penelitian ini menggunakan pengklasifikasian Backpropagation Neural Network dan metode ekspansi fitur Word2vec untuk mengurangi ketidakcocokan kosakata pada data tekstual. Hasil dari penelitian ini menunjukkan dengan menggunakan ekspansi fitur pada algoritma klasifikasi dapat meningkatkan performansi hingga 0.7% dengan nilai akurasi sebesar 72.58%. Dari hasil analisis sentiment terhadap harga saham menunjukkan nilai sentimen dan harga saham memiliki hubungan yang sangat lemah.

Kata kunci : sentimen, saham, *backpropagation*, *word2vec*, ekspansi