

ABSTRAK

Pasar sekunder tempat diperdagangkannya saham merupakan salah satu instrumen pasar modal tempat masuknya investasi. Investor memutuskan untuk membeli atau menjual saham dengan berbagai pertimbangan dan analisa. Penelitian ini bertujuan untuk meramalkan Harga Indeks LQ45 dari variabel makroekonomi periode Januari 2010-Desember 2019.

Dengan penggunaan teknologi Artificial Intelligence, sistem cyber-fisik dapat menghasilkan model algoritmik dengan nilai saham yang sulit diprediksi sehingga sangat membantu investor. Model Memori Jangka Pendek Panjang adalah model yang digunakan Machine Learning untuk memperkirakan nilai saham dengan akurasi yang wajar.

Hasilnya menunjukkan bahwa model yang paling optimal mencapai nilai RMSE sebesar 0.739555398, menunjukkan kemampuannya dalam membuat prediksi harga indeks LQ45 yang cukup akurat berdasarkan faktor indeks makroekonomi yang dipilih dan semakin kecil nilai RMSE maka semakin kuat karena nilainya mendekati 0.

Akademisi dapat melihat bagaimana temuan ini dapat digunakan dalam dunia bisnis dan investasi, sehingga memberikan informasi yang berguna bagi para pakar industri. Hal ini mungkin menghasilkan perkiraan yang lebih tepat dan pemahaman yang lebih baik mengenai perilaku Harga Indeks LQ45.

Kata kunci: indeks LQ45 Harga, peramalan, nilai tukar, suku bunga, volume kredit, harga emas, indeks produksi industri, jumlah uang beredar, stok utang dalam negeri, memori jangka panjang