

BAB 5

KESIMPULAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan penelitian yang telah dilakukan, didapatkan hasil penelitian tentang prediksi harga saham menggunakan model arsitektur *deep learning* LSTM pada saham ICBP, INTP, dan TLKM, dan prediksi risiko menggunakan *Value at Risk* metode *Ekspansi Cornish-Fisher*, disimpulkan sebagai berikut:

- 1) Dari hasil analisis prediksi harga saham menggunakan model arsitektur *deep learning* LSTM pada saham ICBP, INTP, dan TLKM, dapat disimpulkan bahwa performa model sangat dipengaruhi oleh pilihan *optimizer*. Meskipun RMSprop memberikan tingkat akurasi yang baik pada setiap saham, namun penggunaan ADAM, secara umum memberikan performa yang terbaik dan lebih baik dari kebanyakan hasil komputasi. Akan tetapi, hasil dari SGD belum bisa menyamai dari kedua *optimizer* dengan demikian, penggunaan SGD perlu ditingkatkan kembali.
- 2) Analisis *Value at Risk* (VaR) pada tingkat kepercayaan 95% dan 99% memberikan pandangan tentang potensi risiko dan batasan kerugian harian pada investasi masing-masing saham. ICBP dan TLKM menunjukkan tingkat risiko yang terkendali, sementara INTP memiliki tingkat risiko yang sedikit lebih tinggi.

5.2 Saran

Penelitian ini dapat dimaksimalkan lagi untuk mencapai hasil yang lebih bervariasi dan lebih aktual. Diantara itu hal yang bisa dilakukan untuk penelitian selanjutnya adalah sebagai berikut:

- 1) Fokus pada peningkatan model LSTM dengan mengeksplorasi berbagai pengaturan hyperparameter dan struktur model. Melakukan hyperparameter tuning yang lebih beragam, seperti penyetelan *learning rate*.
- 2) Kembangkan strategi lain dalam penggunaan VaR atau gunakan metode VaR yang lain untuk melihat perbedaan hasil analisis VaR dari berbagai metode.