

ABSTRAK

Pergerakan harga saham merupakan fenomena kompleks yang dipengaruhi oleh faktor internal pasar, seperti tren historis, volatilitas, dan likuiditas, serta faktor eksternal, seperti informasi dan sentimen berita. Kondisi ini menjadikan prediksi harga penutupan saham dalam skenario *multi-horizon* penting untuk mendukung pengambilan keputusan investasi, pengelolaan risiko, dan perencanaan portofolio yang lebih terukur, meskipun prediksi deret waktu keuangan tetap menantang karena bersifat dinamis, nonlinier, dan sensitif terhadap informasi baru. Penelitian ini bertujuan membangun dan mengevaluasi model *Temporal Fusion Transformer* (TFT) serta membandingkannya dengan LLM-TFT, yaitu TFT yang diperkaya fitur sentimen berita berbasis *Really Simple Syndication* (RSS) yang diekstraksi menggunakan *Large Language Model* (LLM), untuk memprediksi harga penutupan saham *blue-chip* di Bursa Efek Indonesia. Objek penelitian mencakup empat emiten, yaitu ASII, BBRI, BMRI, dan TLKM, dengan horizon prediksi H+1 sampai H+3. Penelitian ini meliputi pengumpulan dan prapemrosesan data harga saham serta berita, penyelarasan kalender perdagangan, pembentukan indikator teknikal dan fitur sentimen harian, penyusunan dataset, pelatihan model, serta evaluasi menggunakan MAE, RMSE, MAPE, R^2 , dan *Directional Accuracy* (DirAcc). Hasil evaluasi global pada data *testing* menunjukkan bahwa LLM-TFT memberikan performa agregat yang lebih baik dibandingkan TFT pada seluruh metrik evaluasi. TFT memperoleh RMSE sebesar 132,585, MAE sebesar 96,158, MAPE sebesar 2,259%, R^2 sebesar 0,986, dan DirAcc sebesar 52,343%, sedangkan LLM-TFT memperoleh RMSE sebesar 125,285, MAE sebesar 91,024, MAPE sebesar 2,131%, R^2 sebesar 0,988, dan DirAcc sebesar 58,269%. Temuan ini menunjukkan bahwa penambahan fitur sentimen berita memberikan kontribusi positif terhadap performa prediksi harga saham secara agregat, baik pada ketepatan nilai prediksi maupun ketepatan arah pergerakan harga saham.

Kata kunci : analisis sentimen berita, LLM-TFT, *multi-horizon forecasting*, prediksi harga saham, saham *blue-chip*, *Temporal Fusion Transformer*