

Analisis Sentimen Media Sosial Twitter terhadap Performa Saham Perusahaan di Indonesia = Sentiment Analysis Twitter on Stock Performance in Indonesia.

Selvi Lesmana Putri, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20506879&lokasi=lokal>

Abstrak

Makalah ini bertujuan untuk menyelidiki korelasi antara Twitter dan kinerja pasar saham dengan melihat perspektif tingkat industri untuk perusahaan tertentu yang tergabung dalam IDX30. Indeks saham ini adalah sub-kategori likuiditas dari Headline Index yang terdiri dari perusahaan-perusahaan yang digunakan sebagai referensi untuk menggambarkan situasi pasar saham yang memenuhi kriteria utama memiliki tingkat likuiditas yang tinggi. Untuk mendukung penelitian ini, kami mengumpulkan beberapa pendapat yang diperoleh dari Twitter sebagai sumber data streaming menggunakan pemrograman Python, dan Thomson Reuters untuk mendapatkan informasi harga saham, volume, dan kapitalisasi pasar masing-masing perusahaan. Model penelitian dibangun berdasarkan metode Amihud Illiquidity dan perhitungan volatilitas untuk mengukur korelasi antara analisis sentimen dan kinerja saham. Penelitian ini menunjukkan bahwa analisis sentimen terhadap pernyataan yang diunggah di Twitter memiliki korelasi yang tidak signifikan terhadap likuiditas dan volatilitas saham IDX30 di Indonesia. Namun demikian, penelitian ini belum dapat memisahkan antara tweet yang dihasilkan berdasarkan pendapat pengguna dan tweet yang dibuat berdasarkan permintaan dari pelaku pasar tertentu untuk mempengaruhi nilai saham dengan menyebarkan informasi yang bias untuk memancing reaksi publik.

.....This paper is aimed at investigating the correlation between Twitter and stock market performance by looking at industry-level perspective to specific companies incorporated in the IDX30. This stock index is the sub-category liquidity of the Headline Index which consists of companies that are used as a reference to describe the stock market situation that meet the main criteria of having a high level of liquidity. To support this research, we collected some opinions obtained from Twitter as a source of streaming data using Python programming, and Thomson Reuters to obtain information of stock prices, volumes, and market capitalization of each company. Research models are built based on Amihud Illiquidity method and volatility calculation to measure the correlation between sentiment analysis and stock performance. This research shows that sentiment analysis of statements uploaded on Twitter has insignificant correlation to the liquidity and volatility of IDX30 stock in Indonesia. Nevertheless, this research has not been able to separate between tweets which are generated based on user opinion and tweets which are made based on requests from certain market participants to influence the value of shares by spreading biased information to provoke a public reaction.