

Implementasi ridge regresi dan kernel ridge regresi pada prediksi harga saham = Implementation of ridge regression and kernel ridge regression in stock price prediction

Yuniaty, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20368593&lokasi=lokal>

Abstrak

Prediksi harga saham memiliki manfaat terhadap investor untuk dapat melihat bagaimana investasi saham pada sebuah perusahaan di masa yang akan datang. Prediksi harga saham membantu para investor dalam pengambilan keputusan. Untuk melakukan prediksi harga saham digunakan pendekatan analisis teknis dengan menggunakan metode ridge regresi dan kernel ridge regresi. Ridge regresi merupakan metode regresi yang dapat mengatasi terjadinya masalah multikolinieritas. Kernel ridge regresi merupakan kombinasi antara metode kernel dan ridge regresi dengan memetakan input data ke ruang yang berdimensi lebih tinggi. Pada skripsi ini, diimplementasikan metode ridge regresi dan kernel ridge regresi untuk memprediksi harga saham dengan variabel-variabel regresornya merupakan nilai harga saham pada k-hari sebelumnya. Hasil implementasi pada data yang digunakan dalam skripsi ini menunjukkan bahwa metode kernel ridge regresi memberikan tingkat akurasi rata-rata yang lebih baik dibandingkan metode ridge regresi.

.....

Prediction of stock prices has benefits for investors to be able to see how the stock investment in a company in the future. Prediction of stock prices help investors in making decisions. Prediction of stock price used technical analysis approach using kernel ridge regression and ridge regression. Ridge regression is a regression method that can solve the multicollinearity problem. Kernel ridge regression is a combination of ridge regression and kernel methods to map the input data into a higher dimensional space. In this skripsi, the method is implemented to predict the stock price which is the variables regressors based on a value stock price on the previous day. The result of implementation, in this skripsi, indicates that kernel ridge regression method better than ridge regression method.