

Pemodelan fuzzy logic dalam memprediksi momentum pasar saham pada sektor properti dan real estate = A fuzzy logic model to forecast stock market momentum in property and real estate sector

Hulyani Kin Penawar, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20430722&lokasi=lokal>

Abstrak

Pasar modal mempunyai peranan penting untuk perekonomian Indonesia. Pasar modal tidak hanya menunjang perekonomian Indonesia, tetapi juga merupakan salah satu indikator kemajuan perekonomian Indonesia. Salah satu yang diperjualbelikan dalam pasar modal adalah saham (pasar saham). Sekarang ini, pasar saham dipenuhi dengan ketidakjelasan. Nilai saham yang bersifat naik turun mengakibatkan prediksi pasar saham merupakan suatu anjuran untuk mengambil sebuah keputusan dalam dunia pasar saham. Salah satunya yang dapat diprediksi adalah momentum.

Dalam memprediksi momentum pasar saham tersebut dapat digunakan pemodelan fuzzy logic. Dalam melakukan pemodelannya, akan digunakan data historis 14 hari yang terdiri dari nilai open, high, low, dan close untuk memprediksi kategori momentum pasar saham selama 5 hari kedepan. Kategori momentum pasar saham yang akan digunakan ada tiga, yaitu Bullish, Neutral, dan Bearish. Untuk melakukan percobaan akan digunakan data nilai saham perusahaan-perusahaan yang tercatat di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada sektor properti dan real estate.

.....Capital market has important role in Indonesia's economy. Capital market does not only support the economy of Indonesia, but also being an indicator Indonesia's economy improvement. Something that has been traded in stock market is stock (stock market). Nowadays, stock market is full of uncertainty. That uncertainty values make predicting stock market is all that we have to do before we make a decision in stock market. One that can be predicted in stock market is momentum. To forecast stock market momentum, it can use fuzzy logic model.

In the process of modeling, it will be used 14 days historical data that consisting the value of open, high, low, and close, to predict the next 5 days momentum categories. There are three momentum categories namely Bullish, Neutral, and Bullish. To illustrate the fuzzy logic model, we will use stocks data from several companies that listed on Indonesia Stock Exchange (IDX) in property and real estate sector.