

Aplikasi adaptive neuro fuzzy inference system berbasis support vector regression dalam prediksi harga saham di Indonesia = Application of adaptive neuro fuzzy inference system based on support vector regression for forecasting Indonesian stock price

Anita Setianingrum, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20444880&lokasi=lokal>

Abstrak

Prediksi harga saham merupakan hal yang sangat penting bagi investor karena sangat berguna untuk menentukan nilai masa depan dari suatu perusahaan yang sahamnya sedang diperdagangkan di bursa efek. Investor akan mendapatkan keuntungan yang besar dengan prediksi yang tepat, sebaliknya investor akan mendapatkan kerugian jika prediksi yang digunakan tidak tepat. Pada skripsi ini, akan dibahas pembuatan model prediksi Adaptive Neuro Fuzzy Inference System ANFIS dengan menggunakan variabel indikator teknikal terbaik berdasarkan Support Vector Regression SVR yang dilihat dari kecenderungan data historis saham 25 perusahaan dari sub sektor Bank, sektor Keuangan, yang tercatat di Bursa Efek Indonesia. Melalui metode ini, akan didapatkan nilai akurasi model yang cukup baik sedemikian sehingga dapat menjadi rekomendasi bagi investor dalam melakukan prediksi harga saham berdasarkan variabel indikator teknikal terpilih.

.....Forecasting stock price has become an important issue for stock investors because it is very useful to determine the future value of a company whose its share are traded on the stock exchange. Investors will get a profit with a sharp predictions, otherwise they will get loss if the predictions is inappropriately used. This undergraduate thesis will study how to make a model prediction Adaptive Neruo Fuzzy Inference System ANFIS using the best technical indicators. These technical indicators chosen by using Support Vector Regression SVR referred from the tendencies of stock time series data for 25 companies of Banking sub sector, Financial sector, that listed on Indonesian Stock Exchange. Through this method, analyst will get the value of the model rsquo s accuracy, that is good enough. So that it could be a recommendation for investors for forecasting the stock prices using this method with the selected technical indicators.