

Implementasi regresi ridge dan regresi kernel ridge dalam memprediksi harga saham berbasis indikator teknis = Implementing ridge regression and kernel ridge regression for stock prices forecasting based on technical indicator

Tanjung, Alfian Rizqy, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20348195&lokasi=lokal>

Abstrak

Terdapat beberapa cara untuk memprediksi harga saham, ada yang menggunakan analisis runtun waktu, harga saham terdahulu, maupun menggunakan indikator teknis. Indikator teknis merupakan perhitungan matematis terhadap harga atau volume transaksi saham yang hasilnya dapat digunakan untuk memahami kecenderungan harga saham. Regresi ridge merupakan suatu metode regresi yang mampu mengatasi masalah dimana variabel-variabel regresornya tidak bebas linier. Regresi kernel ridge merupakan kombinasi antara regresi ridge dengan metode kernel dengan tujuan agar dapat memberikan hasil prediksi yang lebih baik. Pada skripsi ini, metode regresi ridge dan regresi kernel ridge akan diimplementasikan untuk memprediksi harga saham pada 12 perusahaan. Hasil percobaan menunjukkan bahwa metode regresi kernel ridge memberikan akurasi yang lebih baik daripada metode regresi ridge untuk beberapa perusahaan.

There are various way for predicting stock prices, some using time series analysis, past stock prices, or technical indicator. Technical indicator is a mathematical calculation over the stock prices or stock transaction volume that can be used to understand the stock price trend. Ridge regression is a regression method that can be used to solve the problem when some of the regressor variables are linearly dependent. Kernel ridge regression is a combination of ridge regression and kernel method in purpose to get better prediction. This skripsi will implement ridge regression and kernel ridge regression for stock prices forecasting of 12 companies. The result shows that kernel ridge regression gives better accuracy for stock price forecasting than ridge regression for some companies.