

Implementasi filter kalman pada model local linear trend dalam memprediksi harga saham = Implementation of kalman filter in local linear trend model for stock price forecasting

Nok Siti Maesaroh, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20350783&lokasi=lokal>

Abstrak

Pergerakan harga saham berfluktuasi. Diperlukan suatu metode untuk mengestimasi pergerakannya. Model runtun waktu merupakan suatu model yang dapat digunakan dalam menganalisis pergerakan harga saham. Salah satu model runtun waktu sederhana adalah model local linear trend dengan level stokastik dan slope deterministik. Algoritma filter Kalman dapat digunakan untuk mengestimasi solusi model. Implementasi menggunakan data harga saham BMRI dan LSIP memberikan hasil yang cukup baik dilihat dari nilai rata – rata error relatif dan nilai MSE (mean square error).

The movements of stock price is fluctuate. A method is required to determine such movement. Time series model is one of the models that can be used in analyzing stock price movements. One of the basic model of time series is the local linear trend model with stochastic level and deterministic slope. Kalman filter algorithm can be used to estimate the solution of that model. Implementation on BMRI and LSIP stock price data gives satisfactory results based on the average relative error and MSE (mean square error).