

Memprediksi Return REIT Menggunakan Algoritma Supervised Machine Learning = Forecasting REIT Returns with Supervised Machine Learning Algorithms

Tahtia Anharani Sazwara, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920537663&lokasi=lokal>

Abstrak

Real Estate Investment Trust (REIT) membentuk akses yang lebih mudah dan inklusif ke pasar investasi properti dan memberikan hasil yang lebih stabil dengan resiko lebih rendah relatif dengan direct investment berkat aturan yang mengharuskan minimum 90% dari pendapatan pajak REIT diberikan sebagai dividen. Di sisi lain, penggunaan machine learning dalam memprediksi variabel keuangan kunjung meningkat dalam popularitas dikarenakan efisiensi dan akurasi yang tinggi. Studi ini memanfaatkan algoritma machine learning dalam menemukan prediktor terbaik yang menjadi faktor harga saham REIT. Makalah ini menemukan hubungan signifikan antara nilai buku perusahaan dan hasil dividen terhadap return saham REIT, walaupun tidak dalam arah yang sama dengan literatur lampau terkait.

.....

Real Estate Investment Trust (REIT) opens the door for easier and more inclusive access to the real estate investment market and provides stable, low risk returns thanks to the ruling where at least 90% of a REIT's taxable income must be given out as dividends. On the other hand, the use of machine learning in forecasting finance variables has always been increasing in popularity due to its ability to cut down processing time and its high accuracy. This study is aimed to utilize machine learning algorithms to find the best predictors for REIT returns. This paper found significant relationship between company's book value and its dividend yield towards its stock returns, although not in the same direction as the literature suggests.