

Prediksi Volatilitas Return Saham IDX30 menggunakan model Echo State Network

Muhammad Rizq Athariq¹, Muhammad Rizq Athariq²

^{1,2}Fakultas Informatika, Universitas Telkom, Bandung

¹mrizqathariq@students.telkomuniversity.ac.id, ²denisaepudin@telkomuniversity.ac.id

Abstrak

Prediksi volatilitas return saham merupakan fenomena yang saat ini dampaknya sangat besar terhadap eksistensi pasar finansial. Untuk melakukan suatu prediksi volatilitas banyak model yang dapat digunakan.. Penelitian yang sudah dilakukan untuk memprediksi volatilitas return saham menggunakan *echo state network* didapatkan nilai performansi yang baik jika menggunakan parameter *forecast* 1 langkah waktu dimana didapatkan nilai rata-rata R Square 0.763 pada 15 saham IDX30 dibandingkan dengan menggunakan parameter *forecast* 5 atau 21 langkah waktu. Dan rata-rata nilai MSE dari 15 saham IDX30 memiliki nilai 2.312 ini lebih baik dibandingkan jika menggunakan parameter *forecast* 5 atau 21 langkah waktu.

Kata kunci : volatilitas, return saham, esn