

INTISARI

Penerapan Analisis Dimensi Fraktal dan Eksponen Hurst untuk Mengidentifikasi Karakteristik Indeks LQ45

Oleh

Muhammad Buyung Yasli

20/459345/PA/20006

Penelitian ini menerapkan analisis dimensi fraktal dan eksponen Hurst untuk mengidentifikasi karakteristik pergerakan saham-saham dalam indeks LQ45. Dengan menggunakan metode analisis *rescaled range*, penelitian ini mengukur eksponen Hurst untuk menentukan apakah pergerakan harga saham bersifat persisten, antipersisten, atau acak (*random walk*). Hasilnya menunjukkan bahwa sebagian besar saham dalam indeks LQ45 memiliki karakteristik persisten, menunjukkan kecenderungan untuk melanjutkan tren pergerakan harga yang ada. Temuan ini memberikan wawasan yang berguna bagi investor dalam menyusun strategi investasi jangka panjang dan menunjukkan bahwa analisis eksponen Hurst dapat membantu dalam memprediksi tren saham. Penelitian ini juga memberikan kontribusi terhadap pengembangan metode analisis kuantitatif untuk pasar saham di Indonesia.

ABSTRACT

Application of Fractal Dimension and Hurst Exponent Analysis to Identify Characteristics of LQ45 Index

By

Muhammad Buyung Yasli

20/459345/PA/20006

This study applies fractal dimension and Hurst exponent analysis to identify the characteristics of stock movements in the LQ45 index. Using the rescaled range analysis method, this research measures the Hurst exponent to determine whether stock price movements are persistent, antipersistent, or random walk. The results indicate that most stocks in the LQ45 index exhibit persistent characteristics, showing a tendency to continue existing price trends. These findings provide valuable insights for investors in developing long-term investment strategies and demonstrate that Hurst exponent analysis can assist in predicting stock trends. This study also contributes to the development of quantitative analysis methods for the stock market in Indonesia.