

Доллі Парлагутан Пулунган, Сугенг Вахіуді, Сухарномо Сухарномо, Харджум Мухарам

Використання технічного аналізу у прогнозуванні індексу соціально відповідального інвестування на Індонезійській фондовій біржі

Метою дослідження є аналіз доцільності використання авторегресійної інтегрованої моделі ковзного середнього на Індонезійській фондовій біржі, особливо для соціально відповідального інвестування. Так як авторегресійна інтегрована модель ковзного середнього поєднує в собі авторегресійну модель та модель ковзного середнього, вона вважається ефективним інструментом для прогнозування цін на акції. Вищезгадані моделі часто використовуються для прогнозування цін на акції. Під час дослідження автори використали дані про щоденний індекс SRI-КЕНАТІ за період з 8 червня 2009 р. до 17 липня 2017 р. Результати дослідження показали, що дані про щоденний індекс SRI-КЕНАТІ не є постійними, як наслідок, потребують перетворення. Дані було перетворено на постійні за допомогою процесу перетворення та сезонної диференціації. Більше того, автори роблять висновок про доцільність використання авторегресійної інтегрованої моделі ковзного середнього (3,1,1) та її відповідність до оброблених даних. Вищезгадана модель також є доцільною для використання на Індонезійській фондовій біржі для прогнозування цін на акції.

Ключові слова: авторегресійна інтегрована модель ковзного середнього, індекс SRI-КЕНАТІ, Індонезійська фондова біржа, технічний аналіз, оцінка.

Класифікація JEL: G10, G17.



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), що дозволяє необмежене повторне використання, розповсюдження та відтворення на будь-якому носії за умови наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.

Доллі Парлагутан Пулунган, Сугенг Вахіуді, Сухарномо Сухарномо, Харджум Мухарам

Использование технического анализа в прогнозировании индекса социально ответственного инвестирования на Индонезийской фондовой бирже

Целью исследования является анализ целесообразности использования авторегрессионной интегрированной модели скользящего среднего на Индонезийской фондовой бирже, особенно для социально ответственного инвестирования. Так как авторегрессионная интегрированная модель скользящего среднего сочетает в себе авторегрессионную модель и модель скользящего среднего, она считается эффективным инструментом для прогнозирования цен на акции. Вышеупомянутые модели часто используются для прогнозирования цен на акции. Во время исследования авторы использовали данные о ежедневном индексе SRI-КЕНАТІ за период с 8 июня 2009 г. по 17 июля 2017 г. Результаты исследования показали, что данные о ежедневном индексе SRI-КЕНАТІ не являются постоянными, как следствие, требуют преобразования. Данные были преобразованы в постоянные при помощи процесса преобразования сезонной дифференциации. Более того, авторы делают вывод о целесообразности использования авторегрессионной интегрированной модели скользящего среднего (3,1,1) и её соответствие обработанным данным. Вышеупомянутая модель также является целесообразной для использования на Индонезийской фондовой бирже для прогнозирования цен на акции.

Ключевые слова: авторегрессионная интегрированная модель скользящего среднего, индекс SRI-КЕНАТІ, Индонезийская фондовая биржа, технический анализ, оценка.

Классификация JEL: G10, G17.



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), что позволяет неограниченное повторное использование, распространение и воспроизведение на любом носителе при условии наличия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи.