

ABSTRAK

Salah satu investasi yang memberikan keuntungan yang besar di Indonesia adalah pasar saham. Informasi harga saham mencerminkan kondisi ekonomi suatu negara. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) merupakan grafik saham yang menampilkan pergerakan rata-rata atau indikator seluruh saham yang ada di dalam bursa efek Indonesia. Apabila IHSG meningkat, maka saham-saham dipastikan juga meningkat. Begitu juga jika IHSG melemah maka saham-saham juga dalam kondisi lemah. Oleh karena itu, dibutuhkan langkah yang tepat untuk membantu investor mendapatkan informasi pasar saham seperti memprediksi harga saham. Penelitian ini memprediksi harga penutupan saham Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dengan menerapkan metode Support Vector Machine (SVM). Parameter yang digunakan untuk pemodelan adalah parameter C sebesar 100 dan parameter *gamma* sebesar 0.1 dengan penggunaan kernel RBF dan koefisien determinasi. Sehingga berdasarkan pelatihan, didapat nilai RMSE 49,14 dan koefisien determinasi R^2 0.9847. Setelah melakukan pengujian data, RMSE ditemukan 33.76 dengan R^2 dari 0.9499.

Kata Kunci: Prediksi, IHSG, SVM