

Abstrak

Data indeks harga saham merupakan salah satu contoh data *financial time series* yang sifatnya cenderung berubah-ubah dan mengandung *noise*. Sifat *noise* ini terjadi saat data mengandung sedikit informasi yang dibutuhkan (*less information*). Hal ini tentunya akan mempengaruhi prediksi nilai indeks harga saham. Oleh karena itu dibutuhkan identifikasi dan penghapusan *noise* menggunakan metode *Independent Component Analysis* (ICA), sebelum membangun sistem untuk memprediksi nilai indeks harga saham menggunakan *Support Vector Regression* (SVR).

ICA merupakan teknik baru untuk pemrosesan sinyal statistik. Dengan menggunakan metode ICA, identifikasi *independent component* (ICs) dan penghapusan ICs yang mengandung *noise* dapat dilakukan. ICs yang mengandung banyak informasi (*most information*) akan digunakan sebagai input pada SVR untuk membangun sistem untuk memprediksi nilai *closing* indeks harga saham.

Data *financial time series* yang digunakan adalah data Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan Jakarta Islamic Index (JII).

Kata Kunci: *financial time series*, indeks harga saham, *Independent Component Analysis*, *Support Vector Regression*.