

Abstrak

Dalam tugas akhir ini, diimplementasikannya model gabungan dari *Unscented Kalman Filter* dan *Support Vector Machine* untuk memprediksi harga opsi beli (*call option*) berdasarkan model Black – Scholes. *Unscented Kalman Filter* digunakan untuk memprediksi harga opsi beli pada satu hari ke depan, sedangkan *Support Vector Machine* digunakan untuk mengurangi *error* dari prediksi yang dihasilkan oleh model *Unscented Kalman Filters*. Hasil prediksi yang diperoleh memberikan nilai RMSE sebesar 0.050 dan nilai MAPE sebesar 0.024.

Kata kunci : Prediksi, Opsi, Unscented Kalman Filter, Support Vector Machine