

## ABSTRAK

Prediksi harga saham merupakan salah satu penelitian penting dalam bidang perekonomian. Dalam praktiknya, harga suatu saham dapat diprediksi dengan menggunakan konsep analisis teknikal. Analisis teknikal didasarkan pada prinsip penggunaan data histori harga saham untuk memprediksi pergerakan saham dimasa mendatang. Tujuan dari penelitian ini adalah mengimplementasikan metode *Principal Component Analysis* dan *Hidden Markov Model* di dalam analisis teknikal untuk memprediksi pergerakan harga saham di masa mendatang.

Sistem prediksi menggunakan data saham JKSE.JK, BBNI.JK, dan ANTAM.JK. Hasil dari percobaan dalam tugas akhir ini menunjukkan bahwa PCA dan HMM dapat bekerja dengan baik. Sistem ini memiliki MAPE terbaik sebesar 0,727%.

**Kata kunci** : prediksi harga saham, *time series*, *Principal Component Analysis*, *Hidden Markov Model*