

ABSTRAK

Penelitian ini menggunakan metode gabungan regresi dan rantai markov multivariat. Regresi digunakan untuk mengestimasi parameter model, sedangkan rantai markov multivariat digunakan untuk menentukan peluang pergerakan naik atau turunnya harga emas. Pergerakan harga emas di pengaruhi permintaan pasar, semakin banyak permintaan akan emas maka harga emas akan naik begitu juga sebaliknya. Selain permintaan akan emas, emas juga dipengaruhi oleh nilai tukar dollar terhadap rupiah. Berdasarkan korelasi data antara harga emas dan nilai tukar dollar terhadap rupiah sebesar 39%, artinya ada hubungan linier positif antara harga emas dan nilai tukar dollar terhadap rupiah. Jika nilai harga emas naik maka nilai tukar dollar terhadap rupiah juga naik dan sebaliknya, jika nilai harga emas turun maka nilai tukar dollar terhadap rupiah juga turun. Tujuan dari penelitian ini adalah dapat membentuk model regresi dan rantai markov multivariat untuk prediksi harga emas di Indonesia berdasarkan nilai tukar dollar terhadap rupiah dan mendapatkan akurasi model regresi dan rantai markov multivariat untuk prediksi harga emas. Hasil prediksi harga emas menggunakan model regresi dan rantai markov multivariat mempunyai *mean absolute percentage error* (MAPE) sebesar 10,0738%.

Kata kunci : Harga Emas, Nilai Tukar, Model Regresi, Rantai Markov Multivariat.