

Abstrak

Indeks harga saham merupakan satuan nilai untuk mengetahui pergerakan harga suatu pasar saham atau sebagian pasar saham. Indeks harga saham berfungsi sebagai tolak ukur bagi para pemegang saham untuk mendapatkan keuntungan dalam berinvestasi. Oleh karena itu, diperlukan pemodelan prediksi indeks harga saham untuk membantu para pemegang saham dalam mengambil keputusan. Banyak faktor yang mempengaruhi naik turunnya suatu indeks harga saham. Salah satunya adalah faktor ekspektasi para penjual dan pembeli saham beserta perhatian orang pada informasi naik turunnya harga saham. *Google Search* dapat digunakan oleh para pemegang saham untuk mengetahui info tentang indeks harga saham. Grafik pencarian terhadap *keywords* indeks harga saham pada *Google Search* dapat diakses melalui layanan *Google Trends*. Data pencarian indeks harga saham di *Google Trends* merupakan cerminan perhatian orang terhadap perubahan pergerakan indeks harga saham. Pada tugas akhir ini, dilakukan pemodelan prediksi pergerakan indeks harga saham di Indonesia dengan melibatkan data *Google Trends* menggunakan metode *Support Vector Regression* (SVR). Data indeks harga saham yang digunakan adalah penutupan mingguan indeks IHSG dan LQ45. Pemodelan prediksi indeks IHSG dan LQ45 dengan melibatkan data *Google Trends* memiliki akurasi lebih baik dibandingkan pemodelan tanpa melibatkan data *Google Trends*. Namun nilai akurasi prediksi kedua model tidak signifikan berbeda.

Kata kunci : indeks harga saham, prediksi, *Google Trends*, *Support Vector Regression*, IHSG, LQ45