

Abstrak

Nilai saham merupakan nilai yang sangat krusial untuk diprediksi karena merupakan nilai yang dapat menentukan untung ruginya para pelaku jual beli saham (*trader*). Prediksi nilai saham adalah kegiatan memprediksi atau memperkirakan nilai saham untuk masa yang akan datang. Dengan jumlah modal tertentu dan prediksi yang tepat, akan diperoleh sejumlah keuntungan yang diinginkan. Banyak metode yang digunakan untuk memprediksi nilai saham. Tetapi masalah yang terjadi adalah kesalahan peramalan yang masih diatas 3%. Di dalam masalah prediksi nilai saham, kesalahan masih di atas 3% ada kemungkinan akan menyebabkan kerugian bagi pelaku jual beli saham. Oleh karena itu, penulis merasa perlu untuk membuat sebuah sistem prediksi dengan algoritma *Fuzzy Time Series*. Metode ini mengolah data yang telah lalu kemudian memproyeksikan data yang akan terjadi. Pada metode *Fuzzy Time Series*, variasi data yang akan diprediksi adalah harga penutupan(close). Pada metode ini dapat memperoleh kesalahan prediksi (error rate) di bawah 3%. Sehingga para *trader* terhindar dari kerugian.

Kata kunci : prediksi nilai saham, kesalahan peramalan, *Fuzzy Time Series*