

ABSTRAK

Indeks harga saham atau *stock prices indexes* adalah harga atau nilai dari sekelompok saham yang dikumpulkan berdasarkan kategori tertentu. Indeks ini merupakan indikator pergerakan harga saham dari seluruh saham yang diwakilinya. Perubahan harga saham yang tidak menentu menjadi pertimbangan diperlukannya prediksi untuk harga saham di Indonesia pada Bursa Efek Indonesia. Salah satu model yang dapat digunakan untuk prediksi indeks harga saham adalah Rantai Markov dan Proses Stokastik *Fuzzy*. Tujuan dari penelitian ini adalah memprediksi indeks harga saham di Bursa Efek Indonesia dan perhitungan eror yang diperoleh dari Proses Stokastik *Fuzzy* dan Rantai Markov. Hasil prediksi indeks harga saham menggunakan Rantai Markov dan Proses Stokastik *Fuzzy* mempunyai MAPE (*Mean Absolute Percentage Error*) dari data latih sebesar 1,40355% dan dari data uji sebesar 0,01900404%.

Kata Kunci: Prediksi Indeks Harga Saham ,Indeks Harga saham, Proses Stokastik *Fuzzy*, Rantai Markov, *MAPE*