

Abstrak

Indeks saham LQ45 sangat menarik untuk diprediksi karena mencerminkan performa dari 45 saham-saham teratas di bursa efek Indonesia, yang ditinjau oleh divisi penelitian dan pengembangan IDX. Dalam penelitian ini, Fuzzy time Series dengan model ekspektasi adaptive digunakan untuk memprediksi indeks. Tahapan yang menentukan dan menarik adalah pada fuzzifikasi untuk menentukan nilai linguistik data, serta pembentukan relasi logika Fuzzy dan pemetaannya terhadap grup. Kemudian dilakukan perhitungan nilai prediksi dengan model ekspektasi adaptif. Pada bagian hasil ditampilkan performa prediksi melalui nilai RMSE untuk beberapa skenario terkait teknik *splitting* untuk penentuan nilai linguistik dan pencarian parameter bobot terbaik pada model ekspektasi adaptif. Diskusi performa dilakukan baik untuk prediksi langsung nilai saham maupun prediksi nilai return. Pada penelitian ini didapatkan perbandingan hasil perhitungan *error* RMSE nilai prediksi dengan menggunakan data *close* dan *return*, masing-masing sebesar 2.423 dan 12.288. Hasil dari penelitian ini menggunakan data *close* untuk prediksi indeks LQ45 lebih akurat dibandingkan dengan menggunakan data *return*.

Kata Kunci: prediksi, harga saham, *fuzzy time series*, *adaptive expectation*.