

ABSTRAK

Emas merupakan jenis investasi yang diminati para investor karena memiliki tingkat resiko yang relatif rendah, berfungsi sebagai pelindung kekayaan dan tidak terpengaruhi oleh inflasi. Harga emas selalu mengalami perubahan dari waktu ke waktu, sehingga perlu dilakukan peramalan nilai harga emas dunia untuk beberapa waktu yang akan datang sebagai dasar bagi para investor dalam pengambilan keputusan. Beberapa metode peramalan yang dapat digunakan diantaranya adalah model ARIMA dan metode *Fuzzy Time Series Markov Chain*, dan *Fuzzy Time Series* Klasik. Hasil peramalan dari metode atau model tersebut kemudian dibandingkan tingkat akurasi menggunakan MAE, RMSE, dan MAPE. Pada penelitian ini, hasil peramalan ketiga metode atau model mengikuti pola data pergerakan harga emas aktual, dan diperoleh metode *Fuzzy Time Series Markov Chain* sebagai metode peramalan yang paling baik karena nilai tingkat kesalahannya yang paling kecil.

Kata kunci : emas, *time series*, *fuzzy time series markov chain*, ARIMA.