

ABSTRAK

Saham merupakan salah satu instrumen investasi yang paling populer karena mampu memberikan tingkat keuntungan menarik. Salah satu perusahaan yang cukup dikenal luas dengan posisi kuat secara domestik dan global, serta termasuk dalam IDX30 adalah PT Indofood Sukses Makmur Tbk. Para investor membutuhkan metode peramalan sebagai dasar pengambilan keputusan dalam menghadapi harga saham yang fluktuatif. Penelitian ini bertujuan untuk memodelkan ARIMA dan *Fuzzy Time Series* (FTS) Saxena Easo, serta mengetahui metode terbaik berdasarkan nilai RMSE terkecil. Data yang digunakan yakni data sampel harga penutupan saham harian periode Maret 2023 hingga Oktober 2024. Pembagian data dilakukan menjadi 377 data *training* dan 19 data *testing*. Pada metode ARIMA, model yang memenuhi semua asumsi dan memiliki nilai RMSE terkecil yakni ARIMA (1,1,0) dengan nilai RMSE sebesar 78,2319. Metode FTS Saxena Easo menggunakan logika *fuzzy* menghasilkan nilai RMSE sebesar 46,8767. Hasil menunjukkan bahwa nilai RMSE metode FTS Saxena Easo lebih kecil daripada ARIMA (1,1,0) sehingga FTS Saxena Easo dipilih sebagai metode terbaik. Peramalan menggunakan FTS Saxena Easo menghasilkan nilai *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE) sebesar 0,4745%. Nilai MAPE tersebut kurang dari sama dengan 10% sehingga FTS Saxena Easo dinilai sangat baik dalam meramalkan harga penutupan saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk.

Kata Kunci: Saham, Indofood, ARIMA, *Fuzzy Time Series* Saxena Easo, RMSE, MAPE