

ABSTRAK

Analisis saham merupakan hal yang perlu dilakukan investor sebelum berinvestasi untuk mengetahui kondisi harga saham. Investor dapat melakukan peramalan harga saham dengan melihat pergerakan harga saham dari data di masa lampau. Harga saham setiap saat bisa mengalami fluktuasi atau perubahan secara terus menerus. Logika *fuzzy* merupakan teknik yang dapat digunakan untuk mengatasi hal yang tidak pasti. Metode *Fuzzy Time Series* (FTS) merupakan metode peramalan yang memanfaatkan logika *fuzzy* untuk menganalisis data *time series*. Kelebihan dari FTS adalah mempunyai tingkat akurasi yang baik dan telah banyak dikembangkan menjadi sebuah model yang efektif untuk meramalkan data *time series*, serta tidak memerlukan asumsi seperti pada metode peramalan yang lain. Penelitian ini menggunakan metode FTS model *Chen* dan *Lee* dengan membandingkan tingkat akurasi dari kedua model untuk memilih model yang lebih baik pada peramalan harga penutupan saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk. Data yang digunakan adalah data harian harga penutupan saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk dari tanggal 10 Agustus 2023 hingga 9 Oktober 2024 dengan total 280 data. Data tersebut dibagi menjadi 224 data *training* dan 56 data *testing*. Penerapan metode FTS model *Chen* dan *Lee* pada peramalan data harga penutupan saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk menghasilkan tingkat akurasi peramalan yang sangat akurat. Peramalan menggunakan metode FTS model *Chen* pada data *training* dan *testing* menghasilkan nilai MAPE masing-masing sebesar 1,035% dan 1,289%. Peramalan menggunakan metode FTS model *Lee* pada data *training* dan *testing* menghasilkan nilai MAPE masing-masing sebesar 0,961% dan 1,083%. Model yang lebih baik digunakan pada peramalan data harga penutupan saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk adalah metode FTS model *Lee* yang mana hasil peramalan periode selanjutnya, yaitu periode 10 Oktober 2024 menggunakan metode FTS model *Lee* pada peramalan harga saham PT Indofood Sukses Makmur Tbk adalah Rp 6.957,83 yang masuk ke dalam kategori harga penutupan saham tinggi.

Kata Kunci: Saham, Peramalan, *Fuzzy Time Series*, *Chen*, *Lee*, Indofood, MAPE