

## ABSTRAK

Jumlah investor di pasar modal, khususnya saham terus meningkat. Salah satu indeks yang umum digunakan dalam memantau perkembangan saham di Indonesia adalah Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG). Para investor membutuhkan suatu sistem yang dapat meramalkan pergerakan IHSG untuk membantu pengambilan keputusan. *Fuzzy Time Series* merupakan salah satu metode peramalan yang dapat digunakan. *Fuzzy Time Series* telah mengalami banyak perkembangan. Penelitian ini menggunakan *Fuzzy Time Series Markov Chain* (FTS MC) dan *Fuzzy Time Series Saxena Easo* (FTS SE). Penelitian ini menggunakan data harian dari harga penutupan IHSG dari tanggal 1 Oktober 2024 hingga 8 November 2024. Data tersebut dipisahkan menjadi data *training* dan data *testing*. Berdasarkan hasil penelitian, pendekatan FTS SE memiliki tingkat akurasi yang lebih baik dibandingkan dengan teknik FTS MC dengan nilai sMAPE masing-masing sebesar 1,959% dan 1,589%.

**Kata Kunci:** Peramalan; Fuzzy Time Series; Rantai Markov; Saxena Easo; sMAPE