

## INTISARI

### PERAMALAN HARGA SAHAM ASII DENGAN METODE FUZZY TIME SERIES MARKOV-CHAIN

(Studi Kasus : Harga Saham ASII Periode Januari 2018 – Juni 2022)

Riski Pratama Ramadhan

Program Studi Statistika, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam  
Universitas Islam Indonesia

Peramalan merupakan perkiraan hal yang akan terjadi pada waktu yang akan datang yang akan terjadi pada waktu yang akan datang dapat didasari oleh data yang ada pada waktu yang sekarang atau waktu lampau. Peramalan tentu sangat penting digunakan diberbagai bidang, salah satunya pada bidang pasar modal, seperti halnya saham yaitu salah satu instrumen pasar modal. Misalnya pada saham ASII yang merupakan saham dari perusahaan yang bergerak di sektor industri otomotif. ASII memiliki likuiditas yang tinggi sehingga memiliki kecenderungan yang tinggi untuk terjadi anomali karena banyaknya transaksi oleh investor memungkinkan harga bergerak dengan sangat fluktuatif. Umumnya anomali pasar juga terkait dengan sebuah *event* seperti pembagian dividen dan beberapa kebijakan perusahaan yang dapat berakibat pada reaksi investor memilih strategi terbaik dalam mengelola dan menghadapi harga saham ASII. Maka dari itu para investor ini perlu strategi terbaik agar tidak terjadi kerugian yang fatal. Metode peramalan dengan model time series terdiri dari berbagai metode. Pada penelitian ini akan digunakan metode *Fuzzy Time Series Markov-Chain*. Berdasarkan hasil peramalan dari metode *Fuzzy Time Series Markov-Chain* satu periode kedepan pada bulan Juli 2022 sebesar 79991.429 dengan nilai MAPE sebesar 4% yang berarti kemampuan model peramalan sangat baik.

**Kata Kunci** : ASII, *Fuzzy Time Series*, Investor, *Markov-Chain*, Pasar Modal, Peramalan, Saham.