

ABSTRAK

Prediksi pergerakan harga saham memiliki peran penting dalam membantu investor mengambil keputusan yang tepat berdasarkan performa perusahaan yang tercermin dari pergerakan harga saham. Dalam penelitian ini, penulis meneliti penggunaan *fuzzy time series* untuk prediksi pergerakan harga saham BBRI dari 2423 dataset yang diambil dari situs bri.com. Penelitian ini mengungkapkan bahwa kemampuannya dalam menangani ketidakpastian data melalui pendekatan *fuzzy*, yang memungkinkan data tergabung dalam beberapa kategori *fuzzy* secara bersamaan. Hasil analisis menunjukkan bahwa metode *Fuzzy Time Series* mampu memberikan prediksi yang akurat dengan nilai MSE sebesar 0.0002% pada data validasi dan 0.0006% pada data uji, MAPE sebesar 1.6436% pada data validasi dan 2.5783% pada data uji, AFER sebesar 1.6436% pada data validasi dan 2.5783% pada data uji.

Kata Kunci : Prediksi harga saham, *fuzzy time series*, BBRI, MAPE, AFER, MSE.

ABSTRACT

Stock price movement predictions play a crucial role in helping investors make informed decisions based on company performance, as reflected in stock price movements. In this study, the author examines the use of fuzzy time series to predict stock price using 2,423 datasets obtained from bri.com. This method is chosen for its ability to handle data uncertainty through a fuzzy approach, which allows data to belong to multiple fuzzy categories simultaneously. The analysis shows that the Fuzzy Time Series method provides accurate predictions with an MSE of 0.0002% on validation data and 0.0006% on test data, a MAPE of 1.6436% on validation data and 2.5783% on test data, and an AFER of 1.6436% on validation data and 2.5783% on test data.

Keywords : Stock price prediction, fuzzy time series, BBRI, MAPE, AFER, MSE.

