

## ABSTRAK

Nisa, Rizqi Khoirun. 2021. *Metode Fuzzy Time Series Model Chen dan Heuristic pada Peramalan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)*. Proposal Skripsi. Program Studi Statistika. Universitas Muhammadiyah Semarang. Pembimbing: I. Indah Manfaati Nur, M.Si., II. Fatkhurokhman Fauzi, M.Stat.

Investasi dan pertumbuhan ekonomi saling berhubungan sehingga pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dapat dijadikan tolak ukur untuk melihat kondisi perekonomian suatu negara. Ketika kondisi ekonomi suatu negara menurun, maka IHSG juga akan mengalami penurunan dan mengakibatkan investor akan keluar dari pasar modal. Oleh karena itu perlu dilakukan peramalan agar membantu investor dalam menentukan pilihan menjual, menahan, atau membeli suatu saham. Pada penelitian ini akan dilakukan peramalan IHSG menggunakan metode *Fuzzy Time Series* model Chen dan *Heuristic*. Data yang digunakan adalah data IHSG bulanan dari Januari 2011 sampai dengan Desember 2020. Ketepatan peramalan dari kedua metode ini diukur menggunakan nilai MAE (*Mean Absolute Error*) dan MAPE (*Mean Absolute Percentage Error*). Hasil peramalan IHSG untuk Januari 2021 menggunakan model Chen sebesar Rp 5.973 sedangkan hasil peramalan menggunakan model *Heuristic* maksimal (*increasing*) sebesar Rp 6.165 dan minimal (*decreasing*) sebesar Rp 5.885. Hasil peramalan dari kedua model didapatkan bahwa model *Heuristic* merupakan model terbaik berdasarkan nilai MAE dan MAPE terkecil yaitu sebesar 77,791 dan 1,54%.

Kata Kunci: Chen, *Fuzzy Time Series*, *Heuristic*, IHSG, Ketepatan Peramalan.