ABSTRAK

Syafrida, Irza Mahya. 2021. Peramalan Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Dengan Menggunakan Metode *Fuzzy Time Series-Markov Chain* Skripsi, Program Studi Statistika, Universitas Muhammadiyah Semarang. Pembimbing: I. Indah Manfaati Nur, M.Si., II. Prizka Rismawati Arum, M.Stat.

Salah satu metode peramalan yang paling banyak dikembangkan saat ini adalah *time series*. Proses peramalan sangat penting pada data *time series* karena diperlukan dalam proses pengambilan keputusan. Pada bidang perekonomian peramalan dapat digunakan untuk memantau pergerakan saham yang akan datang. Pada penelitian ini menjelaskan masalah pemodelan pada peramalan Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) menggunakan *Fuzzy Time Series* (FTS) yang dikembangkan dengan kombinasi *Markov Chain*. Pengembangan metode dilakukan dengan cara menginduksi metode *Markov Chain* pada tahapan proses peramalan data Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI). Hasil pengujian menunjukkan bahwa model peramalan *Fuzzy Time Series Markov Chain* (FTSMC) memenuhi kriteria hasil peramalan yang berakurasi tinggi (*Highly Accurate*), dengan persentase peningkatan akurasi 4.236151%.

Kata kunci: *Fuzzy Time Series,* Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI)**,** MAPE, *Markov Chain.*

http://repository.unimus.ac.id