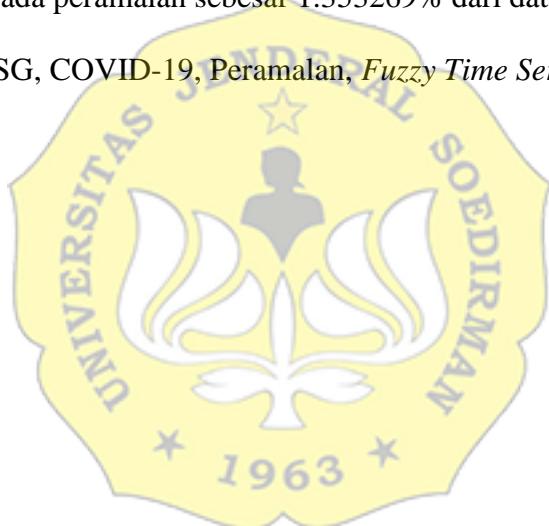


ABSTRAK

Indonesia memiliki potensi menjadi tujuan investasi bagi para investor. Penyebaran wabah COVID-19 yang begitu cepat telah berpengaruh bagi perekonomian, khususnya di pasar modal. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) merupakan suatu rangkaian informasi historis mengenai pergerakan harga saham gabungan sampai waktu tertentu dan mencerminkan suatu nilai yang berfungsi sebagai pengukuran kinerja suatu saham gabungan di Bursa Efek Indonesia. Peramalan berperan penting dalam menentukan IHSG untuk menghasilkan keputusan investasi yang tepat. Salah satu metode yang digunakan untuk menghitung peralaman yaitu metode *Fuzzy Time Series Markov Chain*. Metode ini merupakan penerapan *Fuzzy Time Series* dengan menggunakan rantai Markov. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data harian IHSG yang dihitung pada hari kerja dari tanggal 2 Maret sampai dengan 30 Desember 2020. Hasil penelitian yang diperoleh menggunakan metode *Fuzzy Time Series Markov Chain* adalah IHSG periode 4 Januari 2021 sebesar 5979.073 dengan tingkat penyimpangan pada peramalan sebesar 1.353269% dari data aktual.

Kata kunci: IHSG, COVID-19, Peramalan, *Fuzzy Time Series Markov Chain*



ABSTRACT

Indonesia has the potential to become an investment destination for investors. The rapid spread of the COVID-19 has affected for the economy, especially in the capital market. The Composite Stock Price Index (CSPI) is a series of historical information regarding the movement of the combined stock price to a certain time and reflects a value that serves as a measurement of the performance of a joint stock on the Bursa Efek Indonesia. Forecasting plays an important role in determining the CSPI to produce the right investment decisions. One of the methods used to calculate forecasting is the Fuzzy Time Series Markov Chain method. This method is the application of Fuzzy Times Series using Markov Chain. The data used in this research is the daily data on the CSPI which is calculated on weekdays from March 2 to Desember 30, 2020. The results obtained using the Fuzzy Time Series Markov Chain method are the CSPI period January 4, 2021 amounted to 5979,073 with a deviation rate of 1,353269% in the forecast from the actual data.

Keywords: CSPI, COVID-19, Forecasting, Fuzzy Time Series Markov Chain

