

ABSTRAK

Saham merupakan salah satu jenis investasi yang bisa menghasilkan keuntungan besar. Namun, salah satu masalahnya adalah sulitnya memprediksi harga saham, sehingga sering menimbulkan keraguan dalam menentukan waktu yang tepat untuk membeli atau menjual saham. Pergerakan harga saham yang tidak stabil menimbulkan para investor kebingungan dalam meramalkan harga saham. Data yang digunakan adalah data harga penutupan saham BCA. Peramalan ini menggunakan metode *Fuzzy Time Series* model *Chen* bertujuan untuk menguji keefektifan dan akurasi model *Chen* dalam konteks pasar saham Indonesia. Data historis harga penutupan saham tersebut dianalisis dan digunakan sebagai input untuk model *Fuzzy Time Series*. Periode yang digunakan berawal dari 04 Januari 2021 sampai 28 Juni 2024. Proses peramalan melibatkan beberapa langkah yaitu menentukan interval, menghitung panjang interval, fuzzifikasi, menentukan FLR, menentukan FLR. Hasil dari penelitian metode *fuzzy time series* model *chen* meramalkan selama satu periode adalah 9793 dan menghasilkan nilai *Mean Absolute Percentage* (MAPE) sebesar 1,5748%. Nilai MAPE yang <10% menunjukkan bahwa tingkat kesalahan peramalan sangat rendah, sehingga hasil peramalan ini bisa dikategorikan sebagai peramalan yang akurat.

Kata kunci : Saham, *fuzzy time series chen*, Fuzzifikasi, peramalan