

ABSTRAK

Saham merupakan salah satu investasi yang paling banyak dipilih investor, terutama kalangan milenial yang mulai menyadari pentingnya memiliki instrumen investasi untuk masa depan. Berinvestasi saham dihadapkan dengan ketidakpastian atau risiko yang cukup tinggi. Dengan demikian, diperlukan prediksi bagi para investor dalam pengambilan keputusan investasi. Metode prediksi yang dapat digunakan dalam memprediksi data saham PT Unilever Indonesia Tbk adalah metode *fuzzy time series Chen* dan *fuzzy time series Lee*. Hasil prediksi dari kedua metode kemudian diukur tingkat akurasinya menggunakan MAE dan MAPE. Dengan menggunakan *fuzzy time series Chen* diperoleh nilai MAE sebesar 80,10 dan nilai MAPE sebesar 1,68%, sedangkan dengan menggunakan metode *fuzzy time series Lee* diperoleh nilai MAE sebesar 64,60 dan nilai MAPE sebesar 1,36%. Dari hasil penelitian yang telah dilakukan dapat dibuktikan metode *fuzzy time series Lee* menghasilkan tingkat error lebih rendah dibanding *fuzzy time series Chen*.

Kata kunci : Saham, Prediksi, *Fuzzy Time Series*, *Fuzzy Time Series Chen*, *Fuzzy Time Series Lee*

