

BAB V PENUTUP

5.1 Kesimpulan

Penelitian ini bertujuan untuk memprakirakan Indeks Harga Saham Gabungan untuk periode 01 Januari 2023 – 01 Mei 2024 menggunakan model *Fuzzy Markov Chain Gaussian* EGARCH. Berdasarkan hasil analisis, diperoleh model terbaik EGARCH(1,1) dengan *conditional mean* ARMA(1,2) tanpa rata-rata dengan pemodelan sebagai berikut:

$$\ln \sigma_t^2 = C(4) + c(5) \left| \frac{a_{t-1}}{\sigma_{t-1}} \right| + C(6) \left(\frac{a_{t-1}}{\sigma_{t-1}} \right) + C(7) \ln \sigma_{t-1}^2 \quad (5.1)$$
$$\ln \sigma_t^2 = 4,65 + 0,34 \left| \frac{a_{t-1}}{\sigma_{t-1}} \right| - 0,24 \left(\frac{a_{t-1}}{\sigma_{t-1}} \right) + 0,53 \ln \sigma_{t-1}^2$$

dengan

$$Z_t = a_t + Z_{t-1} + 0,15 a_{t-1} + 0,12 a_{t-2} \quad (5.2)$$

Model yang dipilih telah berhasil memprakirakan nilai Indeks Harga Saham Gabungan untuk periode 01 Juni 2024 – 01 Agustus 2024 dengan nilai akurasi peramalan berdasarkan akurasi data *training* dengan metode MAPE sebesar 4,55%.

5.2 Saran

Pada penelitian ini digunakan fungsi keanggotaan Gauss, sehingga disarankan untuk penelitian selanjutnya bisa dilakukan perbandingan peramalan menggunakan fungsi keanggotaan lainnya untuk mengetahui fungsi keanggotaan apa yang paling sesuai untuk peramalan *Fuzzy Markov Chain* EGARCH.