

ABSTRAK

Skripsi dengan judul “Efektivitas Analisis Teknikal Indikator *Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator* Dan *Relative Strength Index* Dalam Menentukan Sinyal Jual Dan Sinyal Beli Pada Saham PT Adaro Energy Tbk, PT AKR Corporindo Tbk dan PT Aneka Tambang Tbk” ini ditulis oleh Abdulloh Anwar, NIM. 12406173011, pembimbing Dr. Deny Yudiantoro, S.AP.M.M.

Penelitian ini dilatarbelakangi adanya tertarik untuk menguji tidak adanya perbedaan antara prediksi dengan kenyataan pada sinyal jual dan sinyal beli menggunakan indikator adalah *Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator* dan *Relative Strength Index* dan indikator manakah yang paling efektif, karena para investor pastinya berfikir bagaimana langkah dan waktu yang tepat dalam mengambil keputusan investasi sehingga dapat mendatangkan keuntungan dengan menggunakan analisis teknikal.

Rumusan masalah dalam penelitian ini adalah (1) Apakah sinyal jual dan sinyal beli pada indikator *Moving Average Convergence Divergence* dapat menunjukkan keefektifan dengan tidak adanya perbedaan yang signifikan antara prediksi dengan kenyataan dalam perdagangan saham yang terdaftar di JII? (2) Apakah sinyal jual dan sinyal beli pada indikator *Stochastic Oscillator* dapat menunjukkan keefektifan dengan tidak adanya perbedaan yang signifikan antara prediksi dengan kenyataan dalam perdagangan saham yang terdaftar di JII? (3) Apakah sinyal jual dan sinyal beli pada indikator *Relative Strength Index* dapat menunjukkan keefektifan dengan tidak adanya perbedaan yang signifikan antara prediksi dengan kenyataan dalam perdagangan saham yang terdaftar di JII? (4) Indikator manakah yang paling efektif dari indikator *Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator* dan *Relative Strength Index* dalam menentukan sinyal jual dan sinyal beli pada perdagangan saham yang terdaftar di JII?

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan jenis penelitian deskriptif. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling*. Data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh dari data historis harga saham harian penutupan PT. Andaro Energy Tbk, PT. AKR Corporindo Tbk, dan PT. Aneka Tambang Tbk periode Juli 2019- Oktober 2021. Penelitian ini menggunakan teknik analisis menggunakan metode uji hipotesis dengan Uji Mann Whitney.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa (1) Tidak terdapat perbedaan yang signifikan antara prediksi dengan kenyataan indikator *moving average convergence divergence* dalam menentukan sinyal jual dan sinyal beli, (2) Tidak terdapat perbedaan yang signifikan antara prediksi dengan kenyataan indikator *stochastic oscillator* dalam menentukan sinyal jual dan sinyal beli, (3) Tidak terdapat perbedaan yang signifikan antara prediksi dengan kenyataan indikator *relative strength index* dalam menentukan sinyal jual dan sinyal beli, (4) Indikator *stochastic oscillator* merupakan indikator yang paling efektif dalam menentukan sinyal jual dan sinyal beli.

Kata Kunci: Analisis Teknikal, Indikator *Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator* dan *Relative Strength Index*

ABSTRACT

The thesis entitled "Effectiveness of Technical Analysis of Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator and Relative Strength Index Indicators in Determining Sell Signals and Buy Signals on stock PT Adaro Energy Tbk, PT AKR Corporindo Tbk and PT Aneka Tambang Tbk " was written by Abdulloh Anwar, NIM. 12406173011, supervisor Dr. Deny Yudiantoro, S.AP.M.M.

This research is motivated by being interested in testing the absence of differences between predictions and reality on sell signals and buy signals using indicators, namely Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator and Relative Strength Index and which indicator is the most effective, because investors must be thinking about the steps and timing. in making investment decisions so that they can bring benefits by using technical analysis.

The formulation of the problem in this study is (1) Can sell signals and buy signals on the Moving Average Convergence Divergence indicator show effectiveness in the absence of significant differences between predictions and reality in trading stocks listed on JII? (2) Can sell signals and buy signals on the Stochastic Oscillator indicator show effectiveness in the absence of significant differences between predictions and reality in trading stocks listed on JII? (3) Can sell signals and buy signals on the Relative Strength Index indicator show effectiveness with no significant difference between predictions and reality in trading stocks listed on JII? (4) Which indicators are the most effective of the Moving Average Convergence Divergence, Stochastic Oscillator and Relative Strength Index indicators in determining sell signals and buy signals in trading stocks listed on JII?

This study uses a quantitative approach with a descriptive type of research. The sampling technique used purposive sampling method. The data used is secondary data obtained from historical data of daily closing share prices of PT. Andaro Energy Tbk, PT. AKR Corporindo Tbk, and PT. Aneka Tambang Tbk period July 2019-October 2021. This study uses analytical techniques using the hypothesis test method with the Mann Whitney Test.

The results show that (1) there is no significant difference between the prediction and the reality of the moving average convergence divergence indicator in determining the sell signal and buy signal, (2) there is no significant difference between the prediction and the reality of the stochastic oscillator indicator in determining the sell signal and the buy signal. buy, (3) there is no significant difference between the prediction and the reality of the relative strength index indicator in determining sell and buy signals, (4) the stochastic oscillator indicator is the most effective indicator in determining sell and buy signals.

Keywords: Technical Analysis, Moving Average Convergence Divergence Indicator, Stochastic Oscillator and Relative Strength Index