

ABSTRAK

Skripsi dengan judul “Analisis Teknikal Stochastic Oscillator dan Moving Average Convergence Divergence dalam Pengambilan Keputusan Sell or Buy pada Saham yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (Studi Kasus pada Perusahaan Sektor *Property and Real Estate* Periode Juni 2017-Mei 2022)” ini ditulis oleh Rosyida Nur Aini, NIM. 12406173121, pembimbing Hj. Amalia Nuril Hidayati, M. Sy.

Penelitian ini dilatarbelakangi adanya analisis teknikal yang digunakan para investor untuk mengetahui momen yang sedang terjadi dan menentukan sinyal jual dan beli dalam jual beli saham sehingga investor memperoleh profit yang optimal. Analisis teknikal penting bagi para investor karena berguna untuk mengetahui pergerakan harga saham melalui grafik. Pada penelitian ini indikator yang digunakan berupa Stochastic MACD.

Penelitian ini bertujuan untuk (1) mengetahui momen yang tepat untuk *sell or buy* pada saham perusahaan sektor *property and real estate* yang terdaftar di JII menggunakan indikator Stochastic (2) mengetahui momen yang tepat untuk *sell or buy* pada saham perusahaan sektor *property and real estate* yang terdaftar di JII menggunakan indikator MACD (3) mengetahui indikator yang paling optimal dalam menghasilkan sinyal jual dan sinyal beli dalam memperoleh profit.

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan jenis penelitian deskriptif. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling*. Data yang digunakan yaitu data sekunder yang diperoleh dari data historis *close price* PT. Lippo Karawaci Tbk, PT. Hanson International Tbk. dan PT. Pakuwon Jati Tbk periode Juni 2017-Mei 2022. Penelitian ini menggunakan teknik analisis menggunakan metode *correlogram test* dengan Eviews.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa (1) LPKR menghasilkan 14 kali sinyal jual dan 31 kali sinyal beli. MYRX menghasilkan 5 kali sinyal jual dan 18 kali sinyal beli dan PWON menghasilkan 18 kali sinyal jual dan 28 kali sinyal beli. (2) LPKR menghasilkan 13 kali sinyal jual dan 18 kali sinyal beli. MYRX menghasilkan 5 kali sinyal jual dan 13 kali sinyal beli dan PWON menghasilkan 15 kali sinyal jual dan 20 kali sinyal beli. (3) analisis teknikal dengan menggunakan indikator MACD merupakan indikator yang optimal dalam menentukan sinyal jual maupun sinyal beli dalam menghasilkan *profit* pada transaksi jual beli saham. Hal ini dibuktikan bahwa dari ketiga sampel yang digunakan, dua diantaranya menunjukkan memperoleh keuntungan terbanyak menggunakan indikator MACD.

Kata Kunci: Analisis Teknikal Saham, *Stochastic Oscillator*, *Moving Average Convergence Divergence* (MACD)

ABSTRACT

Thesis with the title "Technical Analysis of Stochastic Oscillator and Moving Average Convergence Divergence in Making Sell or Buy Decisions on Shares Listed in the Jakarta Islamic Index (Case Study on Property and Real Estate Sector Companies for the Period June 2017-May 2022)" was written by Rosyida Nur Aini, NIM. 12406173121, supervisor Hj. Amalia Nuril Hidayati, M. Sy.

This research is motivated by the existence of technical analysis used by investors to find out the moments that are happening and determine buying and selling signals in buying and selling shares so that investors get optimal profit. Technical analysis is important for investors because it is useful for knowing stock price movements through charts. In this study, the indicator used is Stochastic MACD.

This study aims to (1) find out the right moment to sell or buy in the shares of property and real estate sector companies listed in the JII using the Stochastic indicator (2) find out the right moment to sell or buy in the shares of property and real estate sector companies listed in the JII using the MACD indicator (3) find out the most optimal indicator in generating sell signals and buy signals in obtaining profits.

This research uses a quantitative approach with a descriptive research type. The sampling technique uses purposive sampling method. The data used is secondary data obtained from historical close price data of PT Lippo Karawaci Tbk, PT Hanson International Tbk and PT Pakuwon Jati Tbk for the period June 2017-May 2022. This study uses analysis techniques using the correlogram test method with Eviews.

The results showed that (1) LPKR produced 14 sell signals and 31 buy signals. MYRX generated 5 sell signals and 18 buy signals and PWON generated 18 sell signals and 28 buy signals. (2) LPKR generated 13 sell signals and 18 buy signals. MYRX generated 5 sell signals and 13 buy signals and PWON generated 15 sell signals and 20 buy signals. (3) technical analysis using the MACD indicator is an optimal indicator in determining sell signals and buy signals in generating profits on stock buying and selling transactions. This is evidenced that of the three samples used, two of them showed the most profit using the MACD indicator.

Keywords: Stock Technical Analysis, Stochastic Oscillator, Moving Average Convergence Divergence (MACD)