

ANALISIS KEAKURATAN MOVING AVERAGE CONVERGENCE
DIVERGENCE DAN STOCHOSTIC OSCILLATOR PADA
SUB SEKTOR PERBANKAN YANG TERDAFTAR
DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI)

SKRIPSI



Oleh :

YOLA RAHMADANI
1810070530052

PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI UNIVERSITAS BAITURRAHMAH
PADANG
2022

Yola Rahmadani

Analisis Keakuratan Indikator Moving Average Convergence Divergence dan Stochastic Oscillator Pada Perusahaan Sub Sektor Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI).

ix + 88 halaman + 29 tabel + 3 gambar + 5 grafik + 8 lampiran

ABSTRAK

Investasi adalah suatu kegiatan penanaman modal untuk memperoleh manfaat di kemudian hari. Investasi di pasar saham sangat erat kaitannya dengan risiko perubahan harga. Analisis teknikal dapat digunakan investor untuk meminimalisir risiko yang di sebabkan oleh perubahan harga saham, sehingga mendapatkan keputusan rekomendasi beli atau jual dengan tepat.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis keakuratan metode *Moving Average Convergence Divergence (MACD)* dan *Stochastic Oscillator (SO)* dalam menentukan sinyal membeli dan menjual. Sinyal membeli dan menjual didapatkan dari perpotongan garis *MACD* dan *Stochastic Oscillator* dengan format standar. Konsep pada penelitian ini adalah : 1) membandingkan rata-rata *return* antara *MACD* dan *BHAR* per sub periode. 2) membandingkan rata-rata *return* antara *SO* dan *BHAR*. 3) membandingkan kinerja antara *MACD* dan *BHAR* mana yang lebih akurat. Populasi dalam penelitian ini adalah 43 perusahaan sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Teknik pengumpulan sampel ini menggunakan *purposive Sampling*, berdasarkan kriteria-kriteria seperti : 1) perusahaan yang ada di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2016-2021, 2) perusahaan yang sahamnya aktif, mengalami kondisi *bearish* (tren turun) maupun kondisi *bullish* (tren naik), 3) termasuk ke dalam perusahaan yang menghasilkan fundamental terbaik (yang terdaftar di idx 30), 4) datanya dapat diakses menggunakan aplikasi investing.com. Diperoleh 5 perusahaan yang dapat dijadikan sampel yaitu BBKA, BBNI, BBRI, BBTN dan BMRI. Teknik analisis data menggunakan analisis deskriptif, normalitas, *Independent sample Test* dan *Mann-Whitney U*.

Hasil penelitian menunjukkan disaat pasar sedang stabil sebaiknya kita berinvestasi atau *BHAR*, sebaliknya jika disaat pasar sedang krisis sebaiknya menggunakan analisis teknikal *MACD*

Kata Kunci : Analisis Teknikal, *Moving Average Convergence Divergence*, *Stochastic Oscillator*, *Buy And Hold Strategy*, Sinyal membeli dan menjual.

Daftar Bacaan : 27 (2008 – 2020)

PERNYATAAN PERSETUJUAN

Judul Skripsi : Analisis Keakuratan Indikator Moving Average Convergence Divergence dan Stochastic Oscillator Pada Perusahaan Sub Sektor Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI)

Nama : Yola Rahmadani

NPM : 1810070530052

Program Studi : Manajemen

Fakultas : Ekonomi

Skripsi ini telah diperiksa, disetujui dan dipertahankan di hadapan Tim Penguji Skripsi Fakultas Ekonomi Universitas Baiturrahmah dan dinyatakan LULUS dalam Ujian Komprehensif Pada Tanggal 10 Februari 2022

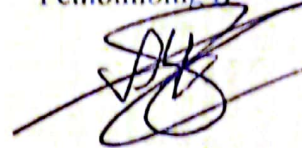
Komisi Pembimbing

Pembimbing I



Yefri Reswita, S.E., M.Si., Akt
NIDN : 1027017001

Pembimbing II



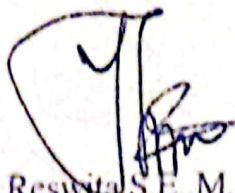
Syaiful, S.E., M.Si
NIDN : 1017157001

Pengesahan

UNIVERSITAS BAITURRAHMAH

FAKULTAS EKONOMI

DEKAN



Yefri Reswita, S.E., M.Si., Akt
NIDN : 1027017001

PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI

Judul Skripsi : Analisis Keakuratan Indikator Moving Average Convergence Divergence dan Stochastic Oscillator Pada Perusahaan Sub Sektor Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI)

Nama : Yola Rahmadani

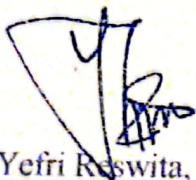
NPM : 1810070530052

Program Studi : Manajemen

Fakultas : Ekonomi

Komisi Pembimbing

Pembimbing I



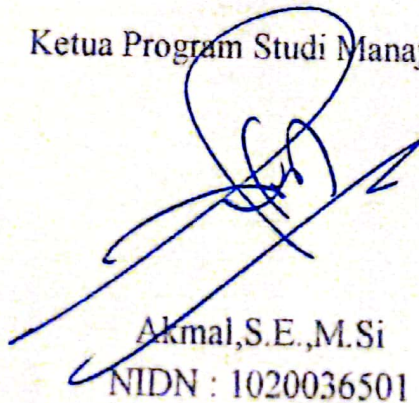
Yefri Reswita, S.E., M.Si., Akt
NIDN : 1027017001

Pembimbing II



Syaiful, S.E., M.Si
NIDN : 1017157001

Ketua Program Studi Manajemen



Akmal, S.E., M.Si
NIDN : 1020036501

SURAT PERNYATAAN

Saya yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : Yola Rahmadani

NPM : 1810070530052

Program Studi : Fakultas Ekonomi

Peminatan : Manajemen

Jenjang : Strata 1

Menyatakan bahwa saya tidak melakukan kegiatan plagiat dalam penulisan skripsi saya yang berjudul : Analisis Keakuratan Indikator Moving Average Convergence Divergence dan Stochastic Oscillator Pada Perusahaan Sub Sektor Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Apabila suatu saat nanti terbukti saya melakukan plagiat, maka saya akan menerima sanksi yang ditetapkan.

Demikian surat pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya.

Padang, Maret 2022



Yola Rahmadani

NPM 1810070530052