

ABSTRAK

ANALISIS AKURASI INDIKATOR SIMPLE MOVING AVERAGE DAN STOCHASTIC OSCILLATOR

(Studi pada Saham Blue Chip Sektor Non Perbankan yang terdaftar di BEI)

Vinsensius Ghana Mahardhika Putra

NIM: 182114134

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

2022

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis keakurasiannya indikator *Simple Moving Average* dan *Stochastic Oscillator* sebagai alat bantu teknikal dalam memberikan sinyal jual dan beli pada pergerakan harga saham *blue chip* pada *sector* non perbankan, di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini juga memberikan analisis tentang kinerja saham *blue chip* selama masa pandemi.

Jenis penelitian ini adalah pendekatan kuantitatif. Teknik pengumpulan data menggunakan metode observasi langsung terhadap pergerakan harga saham yang terdapat dalam aplikasi Ajaib, dan menggunakan dokumentasi dalam bentuk tulisan, angka dan gambar dari laporan serta keterangan yang dapat mendukung penelitian ini. Data dalam penelitian ini adalah arah pergerakan harga, akurasi indikator SMA dan SO, dan return saham.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa indikator *Simple Moving Average* dan *Stochastic Oscillator* memiliki persentase kebenaran sinyal yang berbeda, dimana indikator *Stochastic Oscillator* memiliki persentase kebenaran yang lebih tinggi daripada indikator *Simple Moving Average*.

Kata kunci: Analisis Teknikal, *Simple Moving Average*, *Stochastic Oscillator*

ABSTRACT

ANALYSIS OF THE ACCURACY OF SIMPLE MOVING AVERAGE AND STOCHASTIC OSCILLATOR INDICATOR

(Study on Non-Banking Sector Blue Chip Stocks listed on the IDX)

Vinsensius Ghana Mahardhika Putra

NIM: 182114134

Sanata Dharma University

Yogyakarta

2022

This study aims to analyze the accuracy of the Simple Moving Average and Stochastic Oscillator indicators as technical aids in providing buy and sell signals on blue chip stock price movements in the non-banking sector, on the Indonesia Stock Exchange. This study also provides an analysis of the performance of blue chip stocks during the pandemic.

This research used a quantitative approach. The data collection technique uses the direct observation method of stock price movements contained in the Ajaib application and uses documentation in the form of writing, numbers, and pictures from reports and information that can support this research. The data in this study are the direction of price movement, the accuracy of the SMA and SO indicators, and stock returns.

The results of the study show that the Simple Moving Average and Stochastic Oscillator indicators have different percentages of signal truth, whereas the Stochastic Oscillator indicator has a higher percentage of truth than the Simple Moving Average indicator.

Keywords: Technical Analysis, Simple Moving Average, Stochastic Oscillator