

Nama : Sherly Tinigitan Kirana
NIM : 3012201107
Judul Skripsi : ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA AKURASI
INDIKATOR MOVING AVERAGE CONVERGENCE
DIVERGENCE (MACD) DAN RELATIVE STRENGTH
INDEX (RSI) PADA EMITEN YANG TERDAFTAR PADA
INDEKS SRI-KEHATI PERIODE 2022-2023

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis perbandingan kinerja akurasi indikator Moving Average Convergence Divergence (MACD) dan Relative Strength Index (RSI) pada emiten yang terdaftar pada Indeks SRI-KEHATI periode 2022-2023.

Metodologi penelitian yang digunakan adalah metode penelitian kualitatif dengan pendekatan kuantitatif yang disebut deskriptif kuantitatif, yang secara spesifiknya menggunakan metode komparatif untuk menghasilkan sebuah kesimpulan. Penelitian ini dilakukan dengan objek penelitian yaitu saham SRI-KEHATI periode efektif 2022-2023 yang dicompare dengan top 50 emiten yang memiliki market capital terbesar di IHSG. Sehingga menghasilkan 10 emiten, dengan harapan bahwa objek penelitian yang digunakan dalam penelitian ini dapat merepresentasikan semua saham yang benar-benar aktif diperdagangkan di Bursa Efek Indonesia. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini dibagi menjadi 4 kelompok, yaitu pengumpulan data, pengelolaan data, metode pengujian, dan penarikan kesimpulan.

Pada penelitian ini saya melakukan back testing pada 10 emiten yang menjadi objek penelitian. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa apabila dilihat dari hasil perhitungan tingkat keberhasilan atau success rate terhadap 10 sampel emiten SRI-KEHATI dari tahun 2022 sampai dengan 2023, didapatkan bahwa indikator teknikal Moving Average Convergence Divergence (MACD) lebih unggul sebesar 7 emiten dengan rata-rata success rate sebesar 70,73% berbanding dengan 3 emiten yang dimiliki oleh indikator teknikal Relative Strength Index (RSI) dengan rata-rata success rate sebesar 69,58%. Kemudian dari perbandingan penggunaan kedua indikator, yaitu MACD dan RSI, pada berbagai sektor, sektor-sektor yang paling cocok dalam penggunaan MACD secara khusus adalah sektor Infrastructure, Healthcare, dan Industrial. Sementara untuk sektor Consumer Non-Cyclicals dan Financials, penggunaan kedua indikator tersebut, MACD dan RSI, seimbang atau memiliki presentasi yang sama-sama sebesar 50%.

Kata kunci : Success Rate, MACD, RSI, Indeks SRI-Kehati

Peneliti

Sherly Tinigitan Kirana

3012201107

Nama : Sherly Tinigitan Kirana
NIM : 3012201107
Judul Skripsi : COMPARATIVE ANALYSIS OF THE ACCURACY PERFORMANCE OF THE MOVING AVERAGE CONVERGENCE DIVERGENCE (MACD) AND RELATIVE STRENGTH INDEX (RSI) INDICATORS ON ISSUERS LISTED ON THE SRI-KEHATI INDEX FOR THE PERIODS OF 2022-2023.

ABSTRACT

This study aims to analyze the comparison of the accuracy performance of the Moving Average Convergence Divergence (MACD) and Relative Strength Index (RSI) indicators on issuers listed on the SRI-KEHATI for the periods of 2022-2023.

The research method used is a qualitative research method with a quantitative approach called descriptive quantitative, which specifically uses a comparative method to produce a conclusion. The objects of research is SRI-KEHATI stocks for the effective period 2022-2023 which were compared with the top 50 issuers that have the largest market capital in IHSG. So as to produce 10 issuers, with the hope that the object uses in this study can represent all stocks that are actually actively traded on the Indonesia Stock Exchange. The data analysis techniques used in this study are divided into 4 groups, namely data collection, data management, testing methods, and conclusion drawing.

In this study, I conducted backtesting on 10 issuers that became the object of research. The result of this study indicates that when viewed from the conclusion of the success rate on 10 samples of SRI-KEHATI issuers from 2022-2023, it was found that the Moving Average Convergence Divergence (MACD) technical indicator was superior in 7 issuers with an average success rate of 70,73% compared to 3 issuers owned by the Relative Strength Index (RSI) technical indicators, namely MACD and RSI in various sectors, the most suitable sectors using MACD specifically are the Infrastructure, Healthcare, and Industrial sectors. As for the Consumer Non-Cyclical and Financial sectors, the use of the two indicators is balanced or has the same presentation of 50%.

Keywords : Success Rate, MACD, RSI, Indeks SRI-Kehati

Authors

Sherly Tinigitan Kirana

3012201107