

ABSTRAK

Analisa teknikal secara umum dapat digolongkan menjadi 2 kelas utama, yaitu analisa teknikal klasik dan analisa teknikal modern. Pengguna analisa teknikal klasik, atau yang biasa disebut sebagai *chartist* percaya bahwa *trend* dan sinyal aksi pasar suatu saham dapat diperoleh berdasarkan bentuk dan pola tertentu dari grafik harga saham. Dasar pengambilan keputusan transaksi dalam analisa ini biasanya ditentukan berdasarkan perspektif penggunaannya terhadap suatu grafik sehingga menjadi sangat subjektif. Lain halnya dengan analisa teknikal klasik, analisa teknikal modern melihat *trend* dan sinyal aksi pasar suatu saham berdasar pola grafik yang diindikasikan dari perhitungan kuantitatif sehingga hasilnya objektif. *Trend* pergerakan harga saham berjalan fluktuatif sehingga sulit untuk diprediksi apabila tidak menggunakan sebuah metode sebagai acuan. Salah satu metode yang dapat digunakan untuk mengetahui *trend* pergerakan harga saham yaitu *technical indicators*, dimana *technical indicators* merupakan metode analisis yang dihasilkan dari perhitungan suatu formula atas data-data sebelumnya untuk tujuan memprediksi pergerakan harga saham dikemudian hari.

Multimetods merupakan ringasan dari beberapa model perhitungan atau metode yang digunakan. Adapun metode yang digunakan meliputi *Simple Moving Average (SMA)*, *Exponential Moving Average (EMA)*, *Linear Weighted Moving Average (LWMA)*, *Smoothed Moving Average (SMMA)*, *Weighted Exponential Moving Average (WEMA)*, *Vector Autoregressive (VAR)* dan *Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)*. *Moving Average (MA)* berdasarkan kajian tentang sifat-sifatnya dalam memberikan analisa terhadap prediksi harga saham, MA dapat memberikan sinyal kenaikan (*bullish*) ataupun penurunan (*bearish*) dan bahkan pembalikan *trend* dari saham yang tengah dianalisis. *Autoregressive (AR)* merupakan perhitungan statistika yang berfungsi untuk memprediksi atau meramalkan suatu objek dengan data kuantitatif.

Hasil dari penelitian ini yaitu perbandingan hasil perhitungan dan tingkat kesalahan dari masing-masing model perhitungan dalam 1 periode yang sama, dengan hasil yang didapat yaitu pada 10 sampel perusahaan dengan total data 29318 data, pada peramalan *short-term* dengan periode 10 model terbaik dengan nilai rata-rata MAPE terendah 2.93% yaitu model WEMA, untuk peramalan *medium-term* dengan periode 50 model terbaik dengan nilai rata-rata MAPE terendah 6.87% yaitu model WEMA dan peramalan *long-term* dengan periode 200, model terbaik dengan nilai rata-rata MAPE terendah 3.66% yaitu model ARIMA. Tampilan hasil perhitungan peramalan ditampilkan dalam bentuk chart dapat memudahkan pengguna dalam menentukan garis support, garis resistance dan garis trend serta teknikal analisis lainnya.

Kata Kunci : Harga Saham, Teknikal Analisis, Moving Average, Autoregressive.