

**UJI AKURASI ANALISIS TEKNIKAL *MOVING AVERAGE*, *BOLLINGER BANDS*, DAN *RELATIVE STRENGTH INDEX* PADA HARGA SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DALAM INDEKS LQ45**

**DIPTA AMELIA DANISWARA**

141180218

Mahasiswa Program Studi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

([dadnswr@gmail.com](mailto:dadnswr@gmail.com))

(+62) 85640643545

**ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan memberikan bukti empiris akurasi indikator analisis teknikal *Moving Average*, *Bollinger Bands*, dan *Relative Strength Index* dalam memprediksi arah pergerakan harga saham. Penelitian ini difokuskan pada saham pada emiten yang mewakili pasar saham Indonesia yaitu yang masuk dalam indeks saham LQ45 periode Februari 2021 – Juli 2021. Data penelitian ini didapatkan dari *platform* tradingview.com. Untuk menguji hipotesis penelitian terkait keakuratan indikator *Moving Average*, *Bollinger Bands*, dan *Relative Strength Index* dilakukan uji nonparametrik *Mann-Whitney* yang dapat membuktikan secara statistik apakah terdapat perbedaan antara prediksi arah pergerakan harga saham yang dihasilkan indikator dengan harga kenyataannya. Hasil penelitian ini menemukan tidak ada perbedaan antara prediksi arah pergerakan harga saham yang dihasilkan ketiga indikator dengan harga kenyataan yang berarti ketiga indikator akurat. Dari hasil analisis dan perbandingan kinerja ketiga indikator dari jumlah sinyal, tingkat rata-rata return dan contoh sampel pengamatan maka dapat disimpulkan bahwa indikator *Relative Strength Index* memiliki kinerja akurasi yang lebih optimal dibandingkan dua indikator lainnya. Hasil penelitian ini dapat menjadi referensi bagi investor pasar modal dalam memilih metode analisis teknikal yang dapat membantu pengambilan keputusan investasi yang lebih tepat.

**Kata Kunci :** Analisis Teknikal, *Moving Average*, *Bollinger Bands*, dan *Relative Strength Index*, Pergerakan Harga Saham