

ABSTRAKSI

Sadham Davin Rajendra, Nomor Induk Mahasiswa 152190075, Jurusan Ilmu Administrasi Bisnis Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta dengan judul “Analisis Komparatif Indikator Analisa Teknikal *Moving Average Convergence-Divergence* dan *Stochastic Oscillator* Dalam Menentukan Sinyal Jual dan Beli Studi Kasus Pada Perusahaan Pertambangan Subsektor Batubara Pada Tahun 2020-2022”, 2023. Dosen Pembimbing I oleh Sadeli dan Dosen Pembimbing II oleh Adi Soeprpto.

Penelitian ini bertujuan untuk menjelaskan perbedaan dari penggunaan indikator analisis teknikal *Moving Average Convergence-Divergence* dan *Stochastic Oscillator* mengenai seberapa besar tingkat akurasi dan rata-rata *return* yang dihasilkan. Objek penelitian ini adalah perusahaan pertambangan subsector batubara yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2020-2022. Jenis penelitian yang digunakan adalah penelitian komparatif. Sampel penelitian ini berjumlah 17 perusahaan dan 51 data berdasarkan 3 tahun waktu penelitian. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis tingkat akurasi dan rata-rata *return* berdasarkan sinyal beli dan jual yang dihasilkan oleh indikator *Moving Average Convergence-Divergence* dan *Stochastic Oscillator* yang kemudian diolah menggunakan *software* SPSS.

Berdasarkan hasil analisis komparatif terhadap kedua indikator yang diuji, yaitu *Moving Average Convergence-Divergence* dan *Stochastic Oscillator* didapatkan hasil bahwa *Stochastic Oscillator* memberikan hasil yang lebih baik dari *Moving Average Convergence-Divergence* dalam memberikan sinyal jual dan beli. *Stochastic Oscillator* memiliki tingkat akurasi sebesar 87,63% dan memiliki rata-rata *return* sebesar 12%, sedangkan *Moving Average Convergence-Divergence* memiliki tingkat akurasi sebesar 37,25% dan memiliki rata-rata *return* sebesar 4,82%.

Saran dari penelitian ini untuk penelitian selanjutnya diharapkan dapat menambahkan faktor yang diteliti seperti rata-rata lamanya waktu dalam setiap munculnya sinyal beli dan jual, serta menambah indikator lain untuk diuji. Adapun saran untuk investor baiknya keputusan beli maupun jual tidak hanya bergantung dengan sinyal beli dan sinyal jual yang dihasilkan dari indikator tersebut, tetapi dengan memperhatikan komponen analisis teknikal lainnya.

Kata Kunci: *Moving Average Convergence-Divergence*, *Stochastic Oscillator*, Tingkat Akurasi, Rata-Rata *Return*