

UJI AKURASI ANALISIS TEKNIKAL INDIKATOR *ICHIMOKU KINKO HYO, MOVING AVERAGE CONVERGENCE DIVERGENCE,* DAN *RELATIVE STRENGTH INDEX* PADA HARGA SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DALAM INDEKS INFOBANK15

Adhyaksa Rafi¹, Sri Dwi Ari Ambarwati²

¹²³Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

adhyaksaraf29@gmail.com dwiari.ambarwati@upnyk.ac.id

ABSTRAK

Indikator analisis teknikal adalah alat yang sering digunakan oleh *trader* untuk mendukung proses pengambilan keputusan saat membeli atau menjual. Tujuan penelitian ini adalah untuk menguji keakuratan indikator *Ichimoku Kinko Hyo*, *Moving Average Convergence Divergence*, dan *Relative Strength Index* untuk dijadikan sebagai pedoman dalam memprediksi arah pergerakan harga sehingga *trader* dapat menentukan sinyal jual dan sinyal beli saham di Indeks Infobank15 serta menerapkan disiplin tinggi, *money management* yang efektif, dan menjaga psikologi *trading*. Penelitian ini difokuskan pada saham yang terdaftar dalam Infobank15 dengan interval pengamatan Agustus - Desember 2023. Sumber data menggunakan data sekunder yang diperoleh melalui *platform tradingview*, yang mencakup data historis perdagangan pada *timeframe* harian (D1) pergerakan harga saham. Metode dokumentasi digunakan untuk memperoleh data. Uji *Non-parametrik* Mann-Whitney digunakan untuk menguji seluruh hipotesis penelitian secara statistik komparatif terkait keakuratan indikator *Ichimoku Kinko Hyo*, *Moving Average Convergence Divergence*, dan *Relative Strength Index* yang dapat membuktikan secara statistik apakah terdapat perbedaan antara harga prediksi indikator dengan harga kenyataannya. Hasil penelitian menunjukkan tidak terdapat perbedaan antara sinyal prediksi arah pergerakan harga saham yang dihasilkan *Ichimoku Kinko Hyo* dan *Moving Average Convergence Divergence* dengan harga kenyataan yang berarti keduanya akurat. Namun penelitian menunjukkan adanya perbedaan antara harga prediksi yang dihasilkan *Relative Strength Index* dengan harga kenyataan sehingga dinyatakan tidak akurat. Dari hasil analisis dan perbandingan kinerja ketiga indikator dari jumlah sinyal dan tingkat rata-rata *return* maka dapat disimpulkan bahwa indikator *Moving Average Convergence Divergence* memiliki tingkat *return* yang lebih optimal dibandingkan dua indikator lainnya sedangkan *Ichimoku Kinko Hyo* lebih optimal dalam meminimalisir risiko dibandingkan dua indikator lainnya.

Kata Kunci : Analisis Teknikal, *Ichimoku Kinko Hyo*, *Moving Average Convergence Divergence*, dan *Relative Strength Index*, Infobank15