



JURUSAN AKUNTANSI



**ANALISIS TEKNIKAL SAHAM MENGGUNAKAN KOMBINASI ARIMA
DAN STOCHASTIC OSCILLATOR DALAM MENENTUKAN SINYAL
JUAL DAN BELI SAHAM**

Oleh :

ALINE GRACIA

1710531020

Pembimbing :

Rayna Kartika, S.E, M.Com, Ak, C.A

**Diajukan untuk Memenuhi Sebagian dari Syarat-Syarat Guna Memperoleh
Gelara Sarjana Akuntansi**

PADANG

2021



No. Alumni Universitas:	ALINE GRACIA	No. Alumni Fakultas?
-------------------------	---------------------	----------------------

BIODATA

a). Tempat/ Tgl Lahir: Payakumbuh/ 19 Maret 1999 b). Nama Orang Tua: Mairizon dan Nurfia Eka Putri c). Fakultas: Ekonomi d). Jurusan: Akuntansi e). No BP: 1710531020 f). Tanggal Lulus: 27 Juli 2021 g). Predikat Lulus: Dengan Pujian h). IPK: 3.79 i). Lama Studi: 3 tahun 11 bulan j). Alamat Orang Tua: Jl. Sukarno Hatta No 134 Parit rantang, Kecamatan Payakumbuh Barat, Payakumbuh

Analisis Teknikal Saham Menggunakan Kombinasi ARIMA dan Stochastic Oscillator dalam Menentukan Sinyal Jual dan Beli Saham

Skripsi oleh : **Aline Gracia**

Dosen Pembimbing : **1710531020**

ABSTRACT

The stochastic oscillator is an indicator that functions to determine the momentum of a market so that it can provide information to investors regarding when to buy shares or when to sell shares. Usually, the stochastic oscillator is combined with a moving average which serves to determine the trend in the market. However, sometimes moving averages give wrong signals. To overcome the weakness of the moving average, the ARIMA method is used, this is because ARIMA is considered better at forecasting price trends so that it can provide more accurate signals. The purpose of this study is to provide an overview of stock technical analysis using a combination of ARIMA and stochastic oscillator methods. The approach used in this research is quantitative. The population in this study is all shares belonging to the telecommunications sub-sector listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX), the sample selection using purposive sampling method, obtained 3 companies from 6 companies sampled in this study, TLKM, EXCL, and ISAT. The data in this study is secondary data in the form of daily stock closing prices for the period 10 March 2018-10 March 2021. The results of this study indicate that the best ARIMA model obtained for TLKM, EXCL, and ISAT stocks respectively is ARIMA (0,1,2), ARIMA ([2,19],1,[19]), and ARIMA (5,1,5). The investment decisions made using ARIMA and the Stochastic Oscillator are waiting for a sell signal for TLKM shares, waiting for a buy signal for EXCL shares, and waiting for a sell signal for ISAT shares.

Keywords: Technical Analysis, ARIMA, Stochastic Oscillator, Sell Signals and Buy Signals Stock

ABSTRAK

Stochastic oscillator merupakan indikator yang dapat memberikan informasi kepada investor terkait waktu membeli maupun menjual saham. Biasanya *stochastic oscillator* dikombinasikan dengan *moving average* yang berfungsi untuk mengetahui *trend* pada *market*. Namun, terkadang *moving average* memberikan sinyal yang salah. Untuk mengatasi kelemahan *moving average* maka digunakan metode ARIMA, karena dianggap lebih baik dalam melakukan peralihan trend harga sehingga memberikan sinyal yang lebih akurat. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk memberikan gambaran umum analisis teknikal saham dengan kombinasi metode ARIMA dan *stochastic oscillator*. Pendekatan dalam penelitian ini adalah pendekatan kuantitatif. Populasi dalam penelitian adalah seluruh saham yang tergabung kedalam sub sektor telekomunikasi yang terdaftar pada Bursa Efek Indonesia (BEI), pemilihan sampel menggunakan metode *purposive sampling*, diperoleh 3 perusahaan yang dijadikan sampel dalam penelitian ini yaitu TLKM, EXCL, dan ISAT. Data dalam penelitian ini adalah data sekunder berupa harga penutupan harian saham periode 10 maret 2018-10 Maret 2021. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa model ARIMA terbaik yang diperoleh untuk saham TLKM, EXCL, dan ISAT secara berurutan adalah ARIMA (0,1,2), ARIMA ([2,19],1,[19]), dan ARIMA (5,1,5). Keputusan investasi yang dihasilkan menggunakan ARIMA dan *Stochastic Oscillator* yaitu menunggu sinyal jual untuk saham TLKM, menunggu sinyal beli untuk saham EXCL, dan menunggu sinyal jual untuk saham ISAT.

Kata Kunci : Analisis Teknikal, ARIMA, Stochastic Oscillator, Sinyal Jual dan Sinyal Beli Saham

