

ABSTRAK

Ali Sulaiman. 2021. *Analisis Teknikal Moving Average (MA), Moving Average Convergence Divergence (MACD) Dan Relative Strength Index (RSI) Sebagai Sinyal Beli Dan Jual Dalam Menghasilkan Return (Studi pada Indeks JII yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2018)*. Skripsi, Program Studi Ekonomi Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam. Pembimbing: (I) Drs. Nispan Rahmi, M.Ag, (II) Lutfi Sahal, SHI, M.SI

Kata Kunci: *Moving Average (MA) Moving Average Convergence Divergence (MACD) Relative Strength Index (RSI), Sinyal Beli dan Jual, Return,*

Penelitian ini dilatar belakangi oleh masih banyaknya investor yang membeli saham hanya beracuan pada berita-berita yang mereka dapatkan baik dimedia sosial ataupun rekomendasi yang diberikan oleh *Broker* tanpa melakukan analisa terlebih dahulu sehingga sering terjadi *spekulatif*.

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui tingkat ketepatan sinyal beli dan jual serta tingkat return masing-masing indikator. nantinya hasil penelitian ini diharapkan bisa menjadi bahan pertimbangan dalam mengambil keputusan dan mengurangi sifat spekulatif dalam transaksi saham.

Perusahaan yang diteliti adalah perusahaan yang terdaftar di (JII) periode 2018. Adapun Teknik pemilihan sampel menggunakan *purposive sampling* sehingga jumlah sampel yang memenuhi kriteria sebanyak 27 perusahaan.

Melalui teknik analisis deskriptif kualitatif dengan teknik manual untuk mencari selisih *return* yang dihasilkan antara selisih beli dan jual masing-masing indikator. Dari hasil penelitian didapati indikator (RSI) memiliki tingkat ketepatan transaksi yang lebih baik, (RSI) mampu memberikan konfirmasi sinyal beli dan jual yang lebih cepat dibandingkan dengan indikator (MA) dan (MACD), indikator (RSI) juga terbukti mampu memberikan *return* yang lebih optimal dari 27 perusahaan hanya 5 perusahaan yang menghasilkan *return* negatif dan 22 perusahaan menghasilkan *return* positif, kemudian indikator (RSI) secara keseluruhan menghasilkan *return* lebih tinggi yakni sebanyak 297,35% lebih tinggi dibandingkan indikator (MA) -433,27% dan (MACD) 116,79%.