

ABSTRAK

JUMRIA.2023. Akurasi Moving Average dalam Prediksi Harga Saham pada Jakarta Islamic Indeks (JII 30) di Bursa Efek Indonesia. Skripsi. Jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Makassar. Dibimbing oleh: Mira dan Nurlina.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui tingkat akurasi moving average dalam memprediksi pergerakan saham perusahaan di indeks JII 30 yang dapat menjadi acuan investor saham syariah dalam mengambil keputusan investasi baik itu keputusan menjual ataupun membeli. Jenis penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dengan menggunakan uji non-parametrik Mann-Whitney. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah saham-saham yang terdaftar di JII 30. Dalam pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling* digunakan, 29 saham yang menjadi sampel adalah saham-saham yang mengalami peristiwa golden cross dan death cross pada periode pengamatan, yaitu Januari- Mei 2023. Data diperoleh melalui aplikasi *Profits*. Hasil penelitian ini dalam indeks saham JII 30 yang mengalami sinyal golden cross dan death cross diperoleh 54 sinyal dimana dari semua sinyal tersebut terdapat 44 sinyal yg sukses dan 10 sinyal yang gagal. Dari data tersebut diperoleh tingkat akurasi Moving Average dalam memprediksi harga saham sebesar 81,4%. Berdasarkan temuan penelitian ini dapat memperoleh manfaat dari penggunaan indikator Moving Average untuk memprediksi tren harga di masa depan dan mengidentifikasi kapan harus membeli dan menjual saham untuk memaksimalkan keuntungan.

Kata Kunci: Akurasi, Analisis Teknikal, *Moving Average*

ABSTRACT

JUMRIA.2023. Accuracy of Moving Average in Stock Price Prediction on Jakarta Islamic Index (JII 30) on Indonesia Stock Exchange. Thesis. Department of Accounting, Faculty of Economics and Business, University of Muhammadiyah Makassar. Guided by: Mira and Nurlina.

This study aims to determine the level of accuracy of moving averages in predicting the movement of company shares in the JII 30 index which can be a reference for Islamic stock investors in making investment decisions, both selling and buying decisions. This type of research uses quantitative methods using the Mann-Whitney non-parametric test. The population used in this study are stocks listed in JII 30. In sampling using purposive sampling techniques used, 29 stocks that were sampled were stocks that experienced golden cross and death cross events in the observation period, namely January-May 2023. Data is obtained through the Profits application. The results of this study in the JII 30 stock index that experienced golden cross and death cross signals obtained 54 signals where from all these signals there were 44 successful signals and 10 failed signals. From this data, the accuracy of the Moving Average in predicting stock prices was 81.4%. Based on the findings of this study can benefit from using the Moving Average indicator to predict future price trends and identify when to buy and sell stocks to maximize profits.

Keywords: Accuracy, Technical Analysis, Moving Average

