

ABSTRAK

Melda, 2025. Efektivitas Indikator RSI DAN MACD Dalam Menghadapi Volatilitas Harga Saham. Skripsi Program Studi Akuntansi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Makassar. Dibimbing oleh Pembimbing I Mira., S.E. M.Ak., Ak. dan Pembimbing II Mira., Nurlina, S.E, M.M.

Penelitian ini bertujuan untuk membandingkan Tingkat akurasi indikator relative strength index (RSI) dan moving average convergence divergence (MACD) dalam memprediksi volatilitas saham pada index LQ45 selama periode 1 agustus 2023 hingga 31 juli 2024. Metode penelitian menggunakan pendekatan kuantitatif komparatif dengan data sekunder berupa harga penutupan saham. Analisis dilakukan dengan menghitung akurasi sinyal kedua indikator menggunakan rumus akurasi dan uji mann-whitney untuk menentukan perbandingan signifikan. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa RSI memiliki Tingkat akurasi sebesar 97% dengan 31 sinyal sukses dari 32 sinyal, sementara MACD memiliki Tingkat akurasi sebesar 52% dengan 86 sinyal sukses dari 166 sinyal. Uji statistik menunjukkan tidak terdapat perbedaan signifikan antara kedua indikator ($p = 0,522$). Meskipun RSI lebih akurat, MACD lebih unggul dalam menghasilkan return pada tren jangka Panjang karena sensitivitasnya terhadap perubahan kecil. Penelitian ini menyimpulkan bahwa RSI lebih cocok untuk kondisi pasar oversold dan overbought, sedangkan MACD efektif untuk mengidentifikasi momentum dan arah volatilitas jangka Panjang. Saran penelitian selanjutnya bisa mengkombinasikan indikator teknikal lainnya untuk analisis yang lebih komperhensif. Temuan ini memberikan panduan praktis bagi investor dalam memilih strategi teknikal yang sesuai untuk pengambilan Keputusan investasi.

Kata kunci: Accuracy; Relative Strength Index (RSI); moving average convergence divergence (MACD); Index LQ45

ABSTRACT

MELDA, 2024. Analysis of the Effectiveness of RSI and MACD Indicators in Addressing Stock Price Volatility. Thesis of the Accounting Study Program, Faculty of Economics and Business, University of Muhammadiyah Makassar. Guided by supervisor I Mira., SE.M.Ak.,Ak and supervisor II Nurlina, SE., M.M

This research aims to compare the accuracy levels of the Relative Strength Index (RSI) and Moving Average Convergence Divergence (MACD) indicators in predicting stock volatility on the LQ45 index during the period from August 1, 2023, to July 31, 2024. The research method employs a comparative quantitative approach using secondary data in the form of stock closing prices. The analysis is conducted by calculating the accuracy of signals from both indicators using the accuracy formula and the Mann-Whitney test to determine significant comparisons. The results of this study indicate that RSI has an accuracy level of 97% with 31 successful signals out of 32 signals, while MACD has an accuracy level of 52% with 86 successful signals out of 166 signals. Statistical testing shows no significant difference between the two indicators ($p = 0.522$). Although RSI is more accurate, MACD is superior in generating returns in the long-term trend due to its sensitivity to small changes. This study concludes that RSI is more suitable for oversold and overbought market conditions, while MACD is effective for identifying momentum and long-term volatility direction. Future research suggestions could include combining other technical indicators for a more comprehensive analysis. These findings provide practical guidance for investors in selecting appropriate technical strategies for investment decision-making.

Keywords: Accuracy; Relative Strength Index (RSI); moving average convergence divergence (MACD); Index LQ45