

## INTISARI

### **ANALISIS TEKNIKAL SAHAM MENGGUNAKAN *VARIABLE INDEX DYNAMIC AVERAGE (VIDYA)* DENGAN *EKSPONENSIAL WEIGHTED MOVING AVERAGE***

oleh

Hanna Van Hellen

11/312784/PA/13580

Suatu ruang lingkup keuangan selalu dikaitkan dengan perubahan yang terjadi secara kontinu dan terus menerus setiap harinya, sama halnya dengan pasar perdagangan dunia yang selalu bersifat dinamis oleh pergerakan pedagang yang menyesuaikan perubahan persepsi dan para partisipan terkait. Dengan adanya asumsi tersebut, dibutuhkan suatu indikator dinamis yang dapat mengubah periode waktu dengan cara menganalisis aksi pasar yang terjadi. *Variable Index Dynamic Average (VIDYA)* merupakan salah satu indikator yang secara dinamis dapat mengikuti pergerakan harga saham. VIDYA membutuhkan bobot dalam metode perhitungannya. Dalam skripsi ini, bobot EWMA digunakan untuk menentukan bobot VIDYA. Dalam perhitungan VIDYA dapat digunakan tiga metode berbeda, yaitu Standar deviasi, *Chande Momentum Oscillator*, dan koefisien determinasi. Metode perhitungan tersebut bertujuan menentukan indeks volatilitas yang berfungsi untuk memprediksi pergerakan harga saham dan memprediksi tren di masa yang akan datang. Selain itu, VIDYA dapat digunakan sebagai strategi *trading* guna menentukan sinyal jual atau beli saham dengan cara menggunakan titik *breakout*.

Kata kunci: analisis teknikal, *exponential weighted moving average*, indeks volatilitas, standar deviasi, koefisien determinasi, indikator momentum

## **ABSTRACT**

### **STOCK TECHNICAL ANALYSIS USING VARIABLE INDEX DYNAMIC AVERAGE (VIDYA) WITH EXPONENTIAL WEIGHTED MOVING AVERAGE**

by

Hanna Van Hellen

11/312784/PA/13580

A global finance scope is always related to change-over with a continuous occurring day by day, as in global trade market which has a dynamic movement fitted to a changing suspicion and a participant related. Those assumption make us find a dynamic indicator either that could change the time period by analyzing the market actions. Variable Index Dynamic Average (VIDYA) is one of the indicator which dynamically can follow the movement of the stock price. VIDYA needs weight in its calculation method. In this thesis, EWMA weight is used to determine VIDYA weight. VIDYA can be determined in three different methods, there are deviation standard, Chande Momentum Oscillator, and determination coefficient. Those methods are used to determine the volatility index with the intention to predict the stock's movement price and trend in the future. In addition, VIDYA can be used as a trading strategy to found sell signal or the buying stock condition by using breakout point.

Key word: technical analysis, exponential weighted moving average, volatility indeks, deviasion standard, determination coeeficient, momentm indicator