



DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Prakata	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	viii
Daftar Gambar	ix
Daftar Lampiran	x
Intisari	xi
Abstract	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Perumusan Masalah	8
1.3. Tujuan Penelitian	9
1.4. Manfaat Penelitian	10
1.5. Sistematika Pembahasan	
BAB II TINJAUAN TEORI DAN HIPOTESIS	12
2.1. Pasar Modal Indonesia	12
2.1.1. Pengertian bursa efek dan pasar modal	12
2.1.2. Perkembangan pasar modal Indonesia	12
2.1.3. Karakteristik pasar modal Indonesia	14
2.2. Efisiensi Pasar Modal	15
2.3. Analisis Teknikal	18
2.3.1. Definisi analisis teknikal	18
2.3.2. Sejarah singkat analisis teknikal	19
2.3.3. Prinsip dasar dan manfaat analisis teknikal	21
2.3.4. Dasar-dasar analisis teknikal	24
2.3.5. <i>Moving average</i> (Rata-rata bergerak)	30
2.4. Tinjauan Penelitian Sebelumnya	34
2.5. Hipotesis	38
BAB III METODE PENELITIAN	41
3.1. Data	41
3.1.1. Obyek penelitian	41
3.1.2. Sumber data	42
3.1.3. Sampel penelitian	42
3.2. Metode Analisis Data	44



BAB IV	ANALISA DAN PEMBAHASAN	54
	4.1. Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 1	54
	4.2. Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 2	56
	4.3. Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 3	58
	4.4. Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 4	60
	4.5. Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 5	62
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	67
	5.1. Kesimpulan	67
	5.2. Saran	68
	Daftar Pustaka	70
	Lampiran	72



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1. Sampel Penelitian	43
Tabel 4.1. Hasil Pengujian Abnormal Return dengan Metode Variable-Length Moving Average	54
Tabel 4.2. Hasil Pengujian Abnormal Return dengan Metode Fixed-Length Moving Average	56
Tabel 4.3. Hasil Pengujian Beda Abnormal Return antara Metode VMA dan FMA	59
Tabel 4.4. Hasil Pengujian Beda Rata-rata Return Beli dan Return Jual dengan Metode Variable-Length Moving Average	61
Tabel 4.5. Hasil Pengujian Beda Rata-rata Return Beli dan Return Jual dengan Metode Fixed-Length Moving Average	63



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1.	Line Chart	24
Gambar 2.2.	Bar Chart	25
Gambar 2.3.	Point and Figure Chart	25
Gambar 2.4.	Candlestick Chart	26
Gambar 2.5.	Up Trend	27
Gambar 2.6.	Down Trend	27
Gambar 2.7.	Sideways Trend	28
Gambar 2.8.	Support and Resistance	29
Gambar 2.9.	Penembusan Titik Support and Resistance	30
Gamabr 2.10	Sinyal Beli dan Sinyal Jual	31
Gambar 3.1.	VMA dan FMA pada Moving Average 10-20	45

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Sampel Penelitian	72
Lampiran 2	Hasil Pengujian Abnormal Return dengan Metode VMA dan FMA Periode 10-20	73
Lampiran 3	Hasil Pengujian Abnormal Return dengan Metode VMA dan FMA Periode 1-50	74
Lampiran 4	Hasil Pengujian Abnormal Return dengan Metode VMA dan FMA Periode 40-50	75
Lampiran 5	Hasil Pengujian Abnormal Return dengan Metode VMA dan FMA Periode 1-200	76
Lampiran 6	Hasil Pengujian Beda Abnormal Return antara Metode VMA dan FMA Periode 10-20	77
Lampiran 7	Hasil Pengujian Beda Abnormal Return antara Metode VMA dan FMA Periode 1-50	79
Lampiran 8	Hasil Pengujian Beda Abnormal Return antara Metode VMA dan FMA Periode 40-50	81
Lampiran 9	Hasil Pengujian Beda Abnormal Return antara Metode VMA dan FMA Periode 1-200	83
Lampiran 10	Hasil Pengujian Beda Rata-rata Return Beli dan Return Jual dengan Metode VMA dan FMA Periode 10-20	85
Lampiran 11	Hasil Pengujian Beda Rata-rata Return Beli dan Return Jual dengan Metode VMA dan FMA Periode 1-50	87
Lampiran 12	Hasil Pengujian Beda Rata-rata Return Beli dan Return Jual dengan Metode VMA dan FMA Periode 40-50	89
Lampiran 13	Hasil Pengujian Beda Rata-rata Return Beli dan Return Jual dengan Metode VMA dan FMA Periode 1-200	91