

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
INTISARI	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian	7
1.5 Manfaat Penelitian	8
1.6 Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Pasar Modal Indonesia	10
2.1.2 Saham	11
2.1.3 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	12
2.1.4 Indeks LQ45 dan Pefindo25	12
2.1.6 <i>Return</i> , Risiko, dan <i>Abnormal Return</i>	13
2.1.7 Strategi Portofolio Aktif dan Portofolio Pasif	15
2.1.8 Analisis Teknikal	17
2.1.9 <i>Moving Average</i> , <i>StochRSI</i> , dan <i>MACD</i>	19

2.1.10 Rasio Sharpe	23
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu	24
2.3 Hipotesis	26
2.4 Model Penelitian.....	27
BAB III METODA PENELITIAN	28
3.1 Desain Penelitian	28
3.2 Populasi dan Sampel	28
3.3 Metoda Pengumpulan Data	29
3.4 Variabel Penelitian	30
3.5 Definisi Operasional Variabel	31
3.6 Metoda Analisis Data	32
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....	37
4.1 Deskripsi Data	37
4.2 Pengujian Kinerja Portofolio Strategi Aktif <i>StochsRSI</i> , <i>MACD</i> , <i>Moving Average</i> dan Strategi Pasif <i>Buy and Hold</i> pada Saham LQ45 dan Pefindo25	39
4.2.1 Hasil Pengujian Kinerja Portofolio Strategi Aktif <i>StochsRSI</i> vs Strategi Pasif <i>Buy and Hold</i> pada Saham LQ45 dan Pefindo25	40
4.2.2 Hasil Pengujian Kinerja Portofolio Strategi Aktif <i>MACD</i> vs Strategi Pasif <i>Buy and Hold</i> pada Saham LQ45 dan Pefindo25	43
4.2.3 Hasil Pengujian Kinerja Portofolio Strategi Aktif <i>MA</i> vs Strategi Pasif <i>Buy and Hold</i> pada Saham LQ45 dan Pefindo25	45
4.2.4 Perbandingan Kinerja portofolio saham <i>StochRSI</i> , <i>MACD</i> , dan <i>MA</i> pada Saham LQ45 dan Pefindo25	47
4.3 Pengujian Hipotesis	51
4.3.1 Uji Hipotesis Perbedaan <i>Return</i> Saham dengan Strategi Teknikal <i>StochRSI</i> Dibandingkan dengan Strategi <i>Buy and Hold</i> pada Periode 1, 2, 4, dan 6 Tahun	51
4.3.2 Uji Hipotesis <i>Return</i> Saham dengan Strategi Teknikal <i>MACD</i> Dibandingkan dengan Strategi <i>Buy and Hold</i> pada Periode 1, 2, 4, dan 6 Tahun	52
4.3.4 Uji Hipotesis <i>Return</i> Saham dengan Strategi Teknikal <i>MA</i> Dibandingkan dengan Strategi <i>Buy and Hold</i> pada Periode 1, 2, 4, dan 6 Tahun	53

4.3.5 Uji Hipotesis perbedaan <i>return</i> portofolio saham antara <i>StochRSI</i> , <i>Moving Average</i> dan <i>MACD</i> pada periode 1, 2, 4, dan 6 tahun.....	54
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	61
5.1 Kesimpulan.....	61
5.2 Implikasi	62
5.3 Keterbatasan	62
5.4 Saran	63
DAFTAR PUSTAKA	64
LAMPIRAN.....	67