

## DAFTAR ISI

	halaman
<b>HALAMAN JUDUL</b>	
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>i</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>iv</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>viii</b>
<b>ABSTRAK..</b> .....	<b>ix</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Perumusan Masalah .....	7
1.3 Tujuan Penelitian .....	7
1.4 Manfaat Penelitian .....	8
1.5 Batasan Penelitian.....	9
<b>BAB II LANDASAN TEORI</b> .....	<b>10</b>
2.1 Pasar Modal .....	10
2.2 Return Saham.....	11
2.3 Analisis Return Saham .....	12
2.4 Analisis Teknikal.....	15
2.5 Indikator Analisis Teknikal .....	18
2.6 Perancangan Sistem Trading .....	30
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b> .....	<b>37</b>
3.1 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian .....	37
3.2 Populasi dan Penentuan Sampel Penelitian .....	37
3.3 Sumber Data dan Pengambilan Data .....	37
3.4 Pengukuran Variabel Penelitian .....	38
3.5 Metode Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	41

<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>41</b>
4.1 Analisis Deskriptif .....	42
4.2 Pengujian Hipotesis .....	48
4.3 Pembahasan .....	53
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>58</b>
5.1 Kesimpulan .....	58
5.2 Keterbatasan .....	58
5.3 Saran .....	59
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>61</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>63</b>

## DAFTAR TABEL

Tabel 1. Perbandingan <i>Dollar-weighted returns</i> dan <i>Time-weighted return</i> .....	13
Tabel 4.1 Daftar 22 Perusahaan LQ45 yang menjadi Sampel Penelitian.....	41
Tabel 4.2 Frekuensi Transaksi 22 Perusahaan LQ45 Berdasarkan Indikator.....	42
Tabel 4.3 Return Saham 22 Perusahaan LQ45 Berdasarkan Indikator.....	49
Tabel 4.4. Hasil Pengujian Hipotesis dengan <i>Independent sample t-test</i> .....	50
Tabel 4.5. Hasil Analisis ANOVA .....	51
Tabel 4.6. Hasil <i>Independent sample t-test</i> dengan strategi buy-hold.....	52

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Indikator Moving .....	23
Gambar 2.2. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Indikator Stochastic .....	24
Gambar 2.3. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Indikator MACD.....	25
Gambar 2.4. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Kombinasi Indikator MA & Stochastic .....	26
Gambar 2.5. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Kombinasi Indikator MA & MACD.....	27
Gambar 2.6. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Kombinasi Indikator MACD dan Stochastic .....	28
Gambar 2.7. Sinyal Buy-Sell Menggunakan Kombinasi Indikator Moving Average, MACD dan Stochastic .....	29
Gambar 4.1 Sinyal Buy-Sell saham AALI dengan Indikator Moving Average ....	43
Gambar 4.2. Sinyal Buy-Sell saham AALI dengan Indikator MACD .....	44
Gambar 4.3. Sinyal Buy-Sell saham AALI dengan Indikator Stochastic .....	44
Gambar 4.4. Sinyal Buy-Sell saham AALI dengan Indikator MACD + Stochastic .....	45
Gambar 4.5. Sinyal Buy-Sell saham AALI dengan Indikator MA + Stochastic ...	46
Gambar 4.6. Sinyal Buy-Sell saham AALI dengan Indikator MA + MACD.....	46
Gambar 4.7. Sinyal Buy-Sell saham AALI Indikator MA+MACD+Stochastic....	47
Gambar 4.1. Return saham 22 Perusahaan LQ45 selama 2010-2014.....	52