

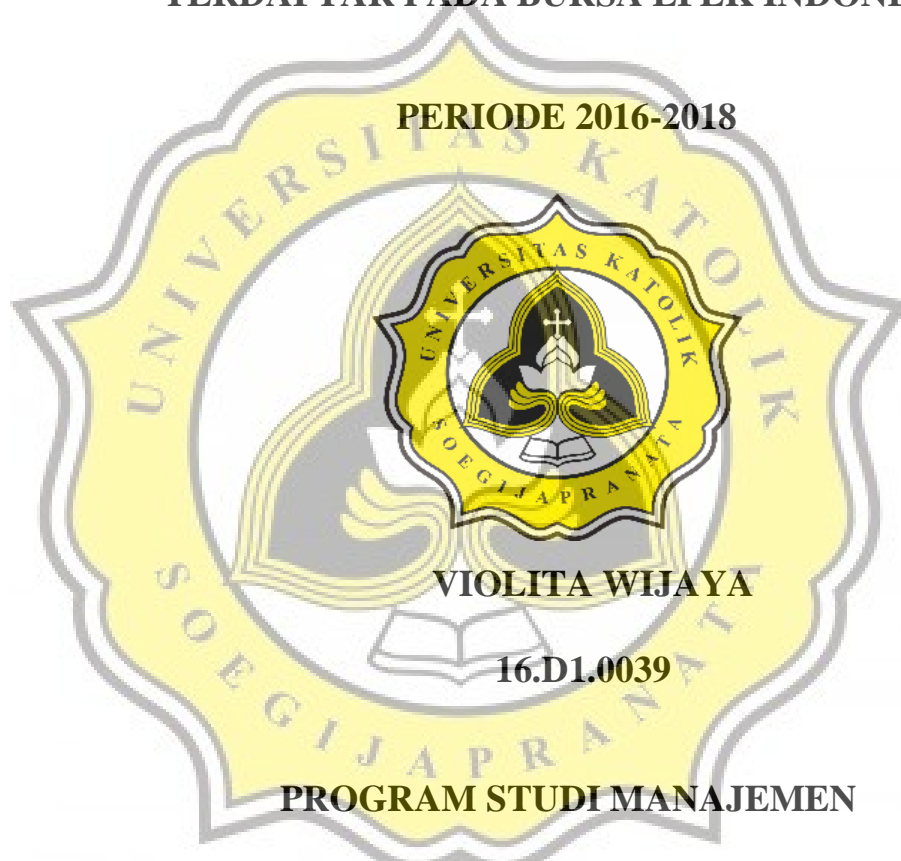
LAPORAN SKRIPSI

PROFITABILITAS ATURAN PERDAGANGAN TEKNIKAL JAPANESE

CANDLESTICK GRAVESTONE DOJI PADA SAHAM YANG

TERDAFTAR PADA BURSA EFEK INDONESIA

PERIODE 2016-2018



VIOLITA WIJAYA

16.D1.0039

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA

SEMARANG

2020

LAPORAN SKRIPSI

PROFITABILITAS ATURAN PERDAGANGAN TEKNIKAL JAPANESE

CANDLESTICK GRAVESTONE DOJI PADA SAHAM YANG

TERDAFTAR PADA BURSA EFEK INDONESIA

PERIODE 2016-2018

**Diajukan dalam Rangka Memenuhi
Salah Satu Syarat Memperoleh Gelar Sarjana**



VIOLITA WIJAYA

16.D1.0039

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA
SEMARANG**

2020

HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS

Yang bertanda tangan dibawah ini:

Nama : Violita Wijaya

NIM : 16.D1.0039

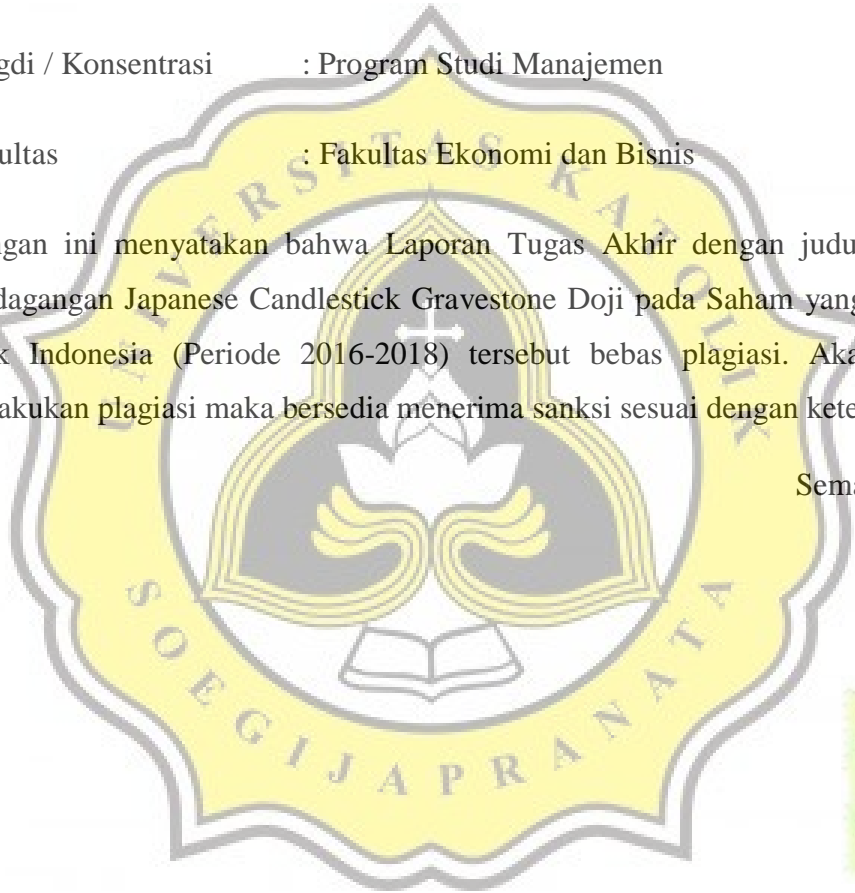
Progdi / Konsentrasi : Program Studi Manajemen

Fakultas : Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Dengan ini menyatakan bahwa Laporan Tugas Akhir dengan judul Profitabilitas Aturan Perdagangan Japanese Candlestick Gravestone Doji pada Saham yang Terdaftar pada Bursa Efek Indonesia (Periode 2016-2018) tersebut bebas plagiasi. Akan tetapi bila terbukti melakukan plagiasi maka bersedia menerima sanksi sesuai dengan ketentuan yang berlaku.

Semarang, 5 Oktober 2020

Yang menyatakan,



Violita Wijaya

HALAMAN PENGESAHAN



Judul Tugas Akhir: : Profitabilitas Aturan Perdagangan Teknikal Japanese Candlestick Gravestone
Doji Pada Saham Yang Terdaftar Pada Bursa Efek Indonesia Periode
2016-2018

Diajukan oleh : Violita Wijaya

NIM : 16.D1.0039

Tanggal disetujui : 28 Agustus 2020

Telah setuju oleh

Pembimbing : Ricky Dwi Budi Harsono S.E., M.Si.

Penguji 1 : Dr Widuri Kurniasari S.E., M.Si.

Penguji 2 : Y. Wisnu Djati Sasmito S.E., M.Si.

Penguji 3 : Ricky Dwi Budi Harsono S.E., M.Si.

Ketua Program Studi : Dr Widuri Kurniasari S.E., M.Si.

Plt. Dekan : Yusni Warastuti S.E., M.Si.

Halaman ini merupakan halaman yang sah dan dapat diverifikasi melalui alamat di bawah ini.

sintak.unika.ac.id/skripsi/verifikasi/?id=16.D1.0039

HALAMAN PERNYATAAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS

Yang bertanda tangan dibawah ini:

Nama : Violita Wijaya
Program Studi : Program Studi Manajemen
Fakultas : Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Jenis Karya : Skripsi

Menyetujui untuk memberikan kepada Universitas Katolik Soegijapranata Semarang Hak Bebas Royalti Noneklusif atas karya ilmiah yang berjudul “Profitabilitas Aturan Perdagangan Japanese Candlestick Gravestone Doji pada Saham yang Terdaftar pada Bursa Efek Indonesia (Periode 2016-2018)” beserta perangkat yang ada (jika diperlukan). Dengan Hak Bebas Royalti Noneklusif ini Universitas Katolik Soegijapranata berhak menyimpan, mengalihkan media/formatkan, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*), merawat, dan mempublikasikan tugas akhir ini selama tetap mencantumkan nama saya sebagai penulis / pencipta dan sebagai pemilik Hak Cipta.

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

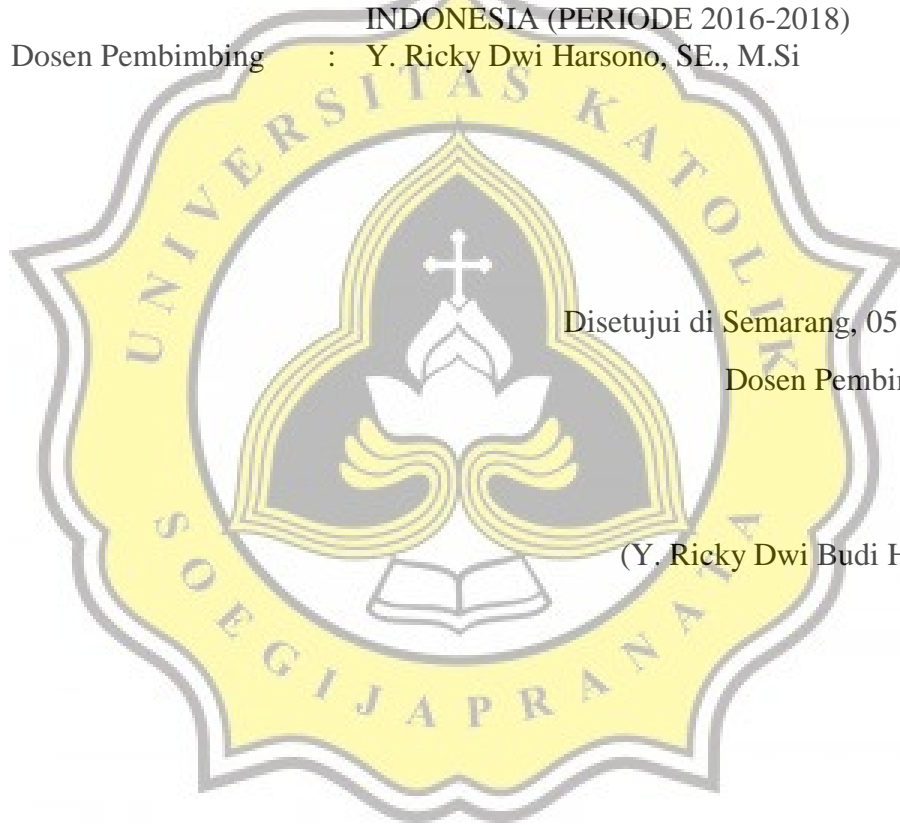
Semarang, 5 Oktober 2020

Yang menyatakan,


Violita Wijaya

HALAMAN PERSETUJUAN

Nama : Violita Wijaya
NIM : 16.D1.0039
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis
Program Studi : Manajemen
Judul : PROFITABILITAS ATURAN PERDAGANGAN
TEKNIKAL *JAPANESE CANDLESTICK*
GRAVESTONE DOJI PADA SAHAM YANG
TERDAFTAR PADA BURSA EFEK
INDONESIA (PERIODE 2016-2018)
Dosen Pembimbing : Y. Ricky Dwi Harsono, SE., M.Si



Disetujui di Semarang, 05 Oktober 2020

Dosen Pembimbing,

(Y. Ricky Dwi Budi Harsono, SE., M.Si)

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan kepada Tuhan Yang Maha Esa atas segala limpah rahmat dan karunia-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan proposal penelitian ini dengan judul “PROFITABILITAS ATURAN PERDAGANGAN TEKNIKAL *JAPANESE CANDLESTICK GRAVESTONE DOJI* PADA SAHAM YANG TERDAFTAR BURSA EFEK INDONESIA (PERIODE 2016-2018)”.

Penulis menyadari bahwa dalam proses penyusunan proposal penelitian ini segala kelancaran dan keberhasilannya tidak lepas dari dukungan berbagai pihak yang memberikan semangat, doa, motivasi, dan bimbingan. Oleh karena itu, pada kesempatan ini penulis ingin mengucapkan terima kasih kepada :

1. Tuhan Yang Maha Esa atas anugerah-Nya kepada penulis sehingga proses penulisan proposal penelitian dapat berjalan dengan lancar hingga selesai.
2. Kedua orang tua dan dua adik saya yang selalu memberi dukungan dalam bentuk doa dan motivasi selama masa kuliah hingga proses penulisan penelitian ini selesai.
3. Bapak Y. Ricky Dwi Budi Harsono, S.E., M.Si selaku dosen pembimbing yang telah banyak membantu meluangkan waktu, pikiran, dan tenaga dalam membimbing penulis sehingga proposal skripsi ini dapat terselesaikan dengan baik.
4. Ibu Dr. Widuri Kurniasari, SE., MSi dan Bapak Y Wisnu Djati Sasmito, SE., MSi selaku dosen penguji yang telah memberi kritik dan saran kepada penulis.
5. Seluruh Bapak dan Ibu Dosen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Katolik Soegijapranata Semarang yang telah membimbing dan mendidik penulis pada masa perkuliahan.
6. Yoshua yang telah banyak meluangkan waktu pikirannya untuk memberikan saran dan membantu penulis mengerjakan proposal penelitian ini.
7. Nico Caesario yang selalu mendampingi saya dan memberikan semangat, doa dan motivasi dalam menyelesaikan skripsi penelitian ini.
8. Seluruh teman-teman yang selalu memberi semangat, doa, dan motivasi kepada penulis untuk menyelesaikan skripsi penelitian ini.

9. Seluruh pihak yang tidak dapat penulis sebutkan satu per satu yang telah membantu penulis dalam menyelesaikan proposal penelitian ini, baik secara langsung maupun tidak langsung.

Penulis menyadari bahwa proposal penelitian ini masih jauh dari sempurna dan memungkinkan terdapat banyak kekurangan dalam penyusunannya. Oleh karena itu, adanya saran yang relevan dan kritik yang membangun dari semua pihak diharapkan dapat menjadi perbaikan bagi penulis di masa mendatang. Akhir kata penulis sampaikan terima kasih dan semoga hasil yang dituliskan dapat dimanfaatkan sebaik mungkin.



Semarang, 05 Oktober 2020

Peneliti

Violita Wijaya

ABSTRAK

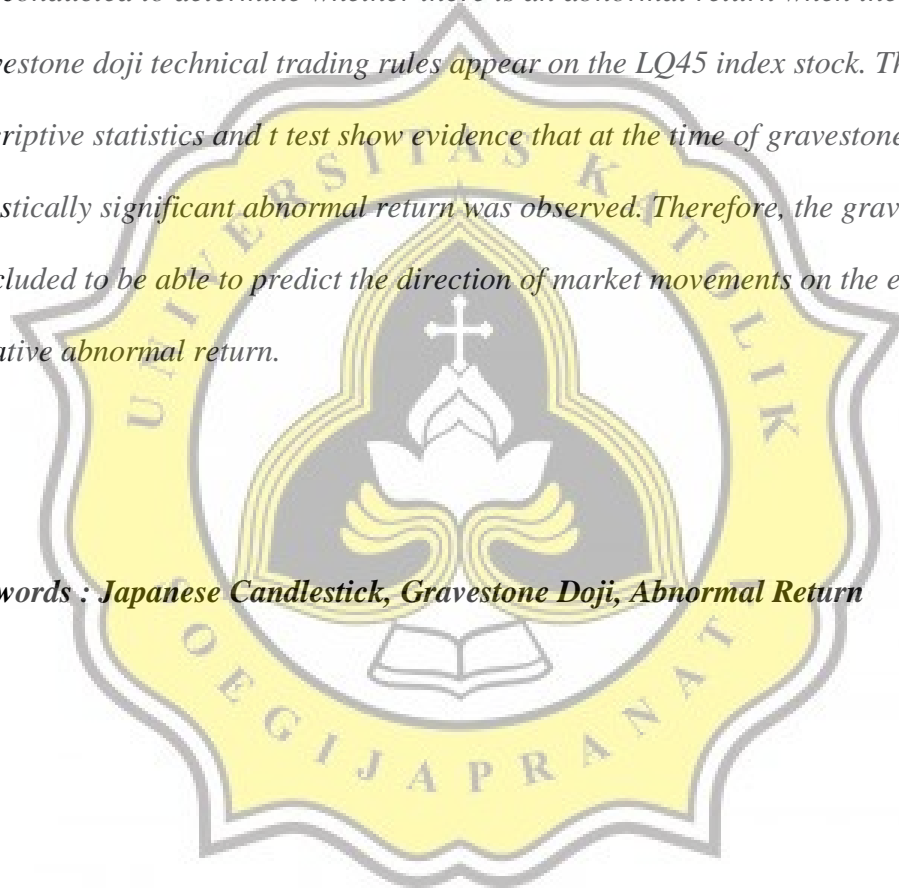
Grafik *Japanese Candlestick* digunakan untuk memprediksi tren harga di masa depan. Doji merupakan salah satu jenis dari candlestick yang didalamnya terdapat gravestone doji yang menjadi objek dalam penelitian kali ini. Penelitian ini dilakukan guna mengetahui ada tidaknya *abnormal return* pada saat muncul aturan perdagangan teknikal *Japanese Candlestick gravestone doji* pada saham indeks LQ45. Hasil statistik deskriptif maupun uji t menunjukkan bukti pada saat terjadinya *gravestone doji* teramati *abnormal return* yang negatif dan signifikan secara statistik. Maka dari itu, pola *gravestone doji* disimpulkan dapat memprediksi arah pergerakan pasar pada *event date* dengan *abnormal return* bertanda negatif.

Kata Kunci : *Japanese Candlestick, Gravestone Doji, Abnormal Return*

ABSTRACT

Japanese Candlestick charts are used to predict future price trends. Doji is one type of candlestick in which there is a gravestone doji which is the object of this research. This research was conducted to determine whether there is an abnormal return when the Japanese Candlestick gravestone doji technical trading rules appear on the LQ45 index stock. The results of both descriptive statistics and t test show evidence that at the time of gravestone doji, a negative and statistically significant abnormal return was observed. Therefore, the gravestone doji pattern is concluded to be able to predict the direction of market movements on the event date with a negative abnormal return.

Keywords : *Japanese Candlestick, Gravestone Doji, Abnormal Return*

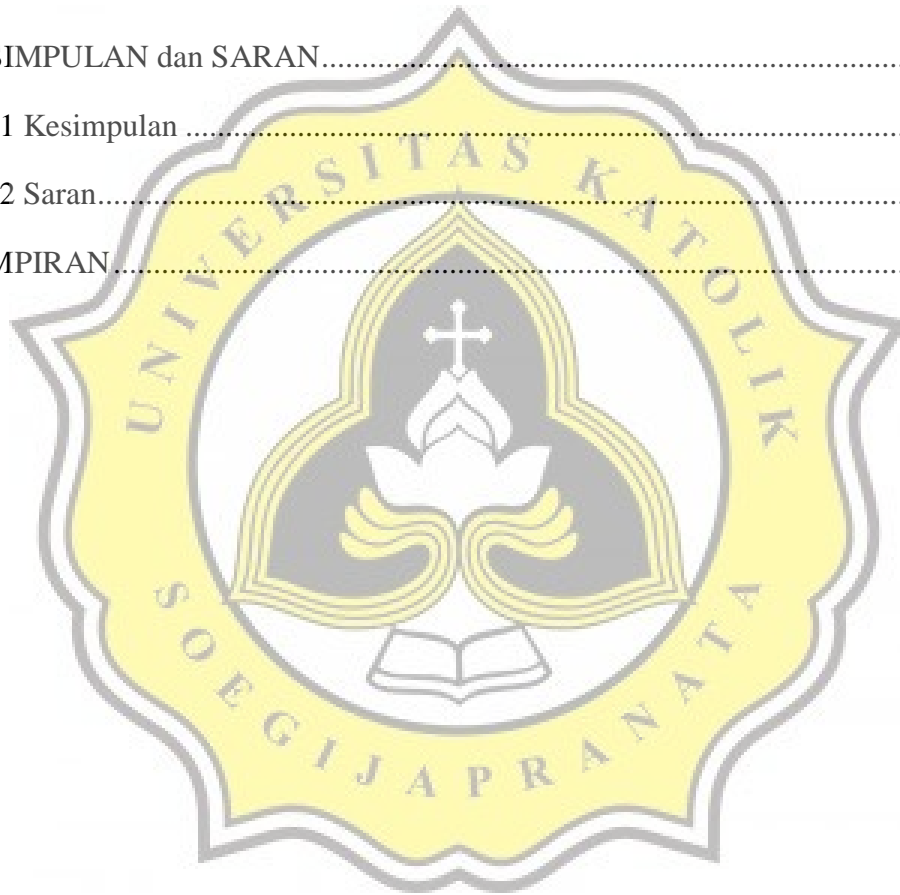


DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH.....	iv
HALAMAN PERSETUJUAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
ABSTRAK.....	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR/DIAGRAM.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
BAB II.....	7
TINJAUAN PUSTAKA dan PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	7
2.1 EMH (Efficient Market Hypothesis).....	7
2.2 Noise.....	8

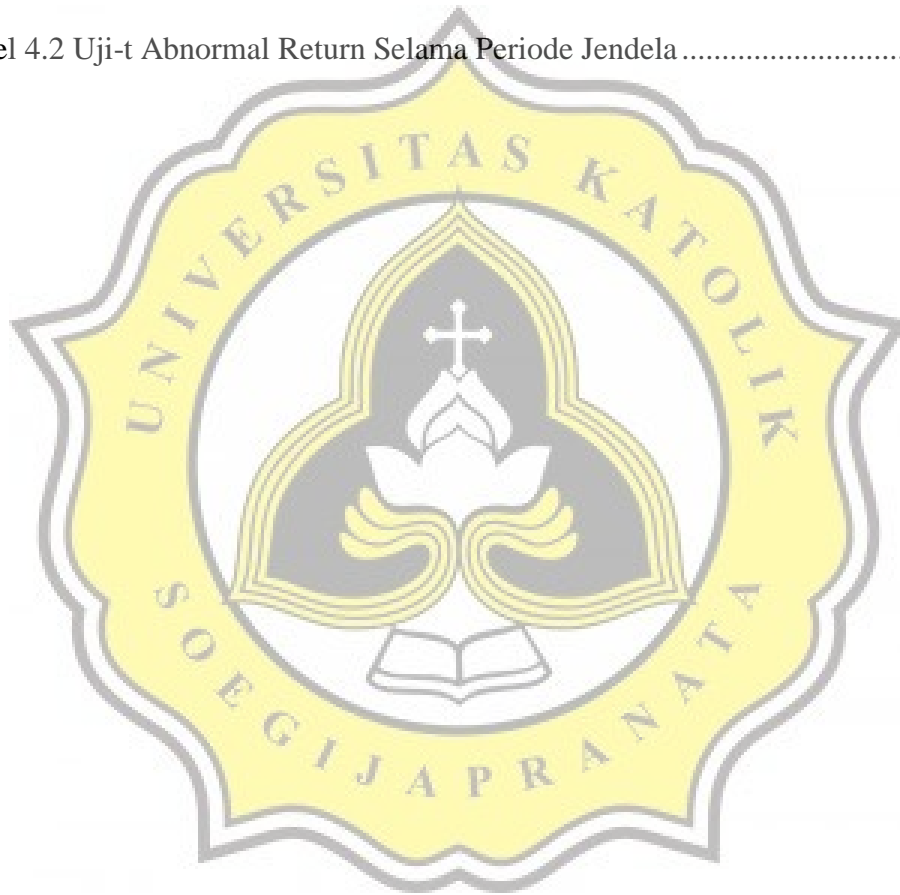
2.3 Analisis Teknikal	8
2.4 Penelitian Terdahulu	8
2.5 Kerangka Pikir Penelitian	10
2.6 Hipotesis Penelitian.....	10
2.5 Definisi Operasional.....	11
2.5.1 Gravestone Doji	11
2.5.2 Return.....	11
2.5.3 Expected Return.....	12
2.5.4 Abnormal Return.....	12
2.5.5 Rata – Rata Abnormal Return.....	13
2.5.6 Deviasi Standar	13
2.5.7 Standard Error of Mean.....	14
2.5.8 Statistik t – Hitung	14
BAB III.....	15
METODOLOGI PENELITIAN.....	15
3.1 Objek, Populasi dan Sampel Penelitian	15
3.2 Metode Pengumpulan Data.....	16
3.2.1 Jenis Data.....	16
3.2.2 Teknik Pengumpulan Data.....	16
3.3.1 Analisis Data	17
3.3.2 Alat Analisis Data	17
3.3.3 Hipotesis Statistik.....	18
3.3.4 Kriteria Penerimaan Hipotesis	19

BAB IV	20
TEMUAN dan PEMBAHASAN	20
4.1 Deskriptif.....	20
4.2 Temuan.....	22
4.3 Pembahasan.....	24
KESIMPULAN dan SARAN.....	27
5.1 Kesimpulan	27
5.2 Saran.....	28
LAMPIRAN.....	31



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Populasi dan Kriteria Pemilihan Sampel	16
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif Abnormal Return	20
Tabel 4.2 Uji-t Abnormal Return Selama Periode Jendela	22



DAFTAR GAMBAR/DIAGRAM

Gambar 1.1 Japanese Candlestick.....	2
Gambar 1.2 Tipe – Tipe Candlestick Doji.....	4
Gambar 2.1 Kerangka Pikir Penelitian.....	10



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Nama Sampel 34 Perusahaan yang Digunakan..... 31

