

Analisis pergerakan harga saham dengan menggunakan metoda directional movement system dengan IHSG dan volume perdagangan saham sebagai variabel kontrol untuk periode Juni 2005-Desember 2005

Purba, Eko Paulen, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=104017&lokasi=lokal>

Abstrak

Penulis melakukan penelitian analisis pergerakan harga saham dengan menggunakan metoda directional movement system dengan IHSG dan volume perdagangan saham sebagai variabel kontrol untuk periode Juni 2005 - Desember 2005 di mana bertujuan untuk mengetahui saham-saham mana yang memiliki keuntungan yang menarik, sehingga pemodal dapat mengidentifikasi saham-saham mana yang sebaiknya di beli dan saham-saham yang sebaiknya di jual dan menjauhi anggapan bahwa pasar modal itu hanya ajang spekulasi. Pengujian dalam penelitian dilakukan dengan dua Cara yaitu pertama dengan analisis teknikal dan kedua secara ekonometrika yaitu analisis regresi berganda. Data yang digunakan merupakan data harga saham harian dari bulan Juni 2005 sampai Desember 2005. Hasil dari penelitian ini adalah secara analisis teknikal dengan periode 1 menunjukkan Plus Directional Movement (+DM), Minus Directional Movement (-DM), True Range, Plus Directional Movement Indicator (+DI), Minus Directional Movement Indicator (-DI) dan Directional Movement Indeks (DX)/ Average Directional index (AMC) memiliki tingkat volatilitas yang tinggi. Sedangkan secara ekonometrika menunjukkan Plus Directional Movement (+DM), Minus Directional Movement (-DM), True Range, Directional Movement Indeks (DX)/ Average Directional index (AMC) sebagai variabel dummy tidak signifikan pengaruhnya terhadap pergerakan harga saham. IHSG (Indeks Harga Saham Gabungan) dan Volume Perdagangan Saham sebagai variabel numerik signifikan pengaruhnya terhadap pergerakan harga saham.

The writer do study about analysis of stock price movement with use directional movement system method with IHSG and volume stock trading as control variables for period June 2005 - December 2005, to intend know which stocks have interesting gain, so the investor can indentify the stocks should buy or sell and it makes assumption away that stock exchange only speculation trading. Test of this research do by two way, first with tehcnical analysis dan second by multiple linear regression. The data that been used is daily stock price form June 2005 until December 2005. The results of this study are by technical analysis with period I shows that Plus Directional Movement (+DM), Minus Directional Movement (-DM, True Range, Plus Directional Movement Indicator (+DI), Minus Directional Movement Indicator (-DI) dan Directional Movement Indeks (DX)/ Average Directional index (ADX) have high volatility. Whereas by multiple linear regression shows that Plus Directional Movement (+DM), Minus Directional Movement (-DM}, True & awe, Directional Movement Indeks (DX)/ Average Directional index (ADX) as a dummy variable not affect significantly to stock price movement. IHSG (Indeks Harga Saham Gabungan) and Volume Stock Trading as a mrmeric variable affect significantly to stock price movement.