

## ABSTRAK

Nama : Eko Wijatmoko  
Program Studi : Magister Manajemen  
Judul : Pengaruh volume transaksi dan variannya pada perdagangan valuta asing (pasangan mata uang GBPUSD) terhadap probabilitas sinyal beli dan sinyal jual pada indikator *Relative Strength Index* (RSI)

Tesis ini membahas pengaruh volume transaksi dan variannya pada perdagangan valuta asing (pasangan mata uang GBPUSD) terhadap probabilitas sinyal beli dan sinyal jual pada indikator *Relative Strength Index* (RSI) dengan menggunakan indikator RSI periode 14 dengan tingkat *overbought* 70, *oversold* 30 serta *cut loss* 20 *pip*, *take profit* 20 *pip*. Dari sinyal beli dan sinyal jual yang terjadi diketahui berapa jumlah sinyal yang profit ( $n$ ) dari total terjadinya peristiwa tersebut ( $N$ ). Untuk masing-masing kesepuluh varian volume pada terjadinya sinyal tersebut dicatat pada poin berapa dan diklasifikasikan dalam kelas tertentu untuk kemudian dicari persamaan logitnya dan juga rerata tingkat kemungkinannya.

Kata kunci :

Valuta asing, analisis teknikal, indikator *Relative Strength Index* (RSI), probabilitas, volume transaksi, regresi *logit*.

## ***ABSTRACT***

Name : Eko Wijatmoko

Study Program : Magister of Management

Title : The influence of transaction volume and its varians in forex trading GBPUSD concerning about buy signal's probability and sell signal's probability in Relative Strength Index (RSI) indicator

The focus of this study is to investigate about the influence of transaction volume and its alternate indicators in forex trading GBPUSD concerning about buy signal's probability and sell signal's probability in Relative Strength Index (RSI) indicator with overbought 70, oversold 30 and cut loss 20 pips, take profit 20 pips. Based on the occurrence of buy signal's and sell signal's, we can identify the correct (value=1) buy signal's frequency and sell signal's frequency (n) comparing to total buy or sell signal's frequency (N). From 10 each varians of volume at the occurrence of signal, we determine it in what point and classify at the particular class point then calculate the logit equation and average probability.

Key words :

Foreign Exchange, technical analysis, Relative Strength Index (RSI) indicator, probability, transaction volume, logit regression.