

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMBUNG.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah.....	6
1.4 Pertanyaan Penelitian	7
1.5 Tujuan Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	8
1.7 Ruang Lingkup Penelitian.....	9
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN.....	11
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian	11
2.1.1 Investasi.....	11
2.1.2 Instrumen Derivatif.....	13
2.1.3 Kontrak Berjangka.....	15

2.1.4 Analisis Fundamental dan Analisis Teknikal.....	17
2.1.5 Analisis Data Deret Waktu	20
2.1.6 Proses Stokastik	21
2.1.7 Model Analisis Data Deret Waktu.....	24
2.1.8 Model ARCH.....	25
2.1.9 Model GARCH.....	27
2.1.10 Kesalahan Peramalan.....	28
2.2 Penelitian Terdahulu	30
2.3 Kerangka Pemikiran.....	41
BAB III METODE PENELITIAN	43
3.1 Karakteristik Penelitian.....	43
3.2 Operasional Variabel.....	44
3.3 Tahapan Penelitian	45
3.4 Populasi dan Sampel	46
3.4.1 Populasi.....	46
3.4.2 Sampel.....	46
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	46
3.6 Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	47
3.6.1 Metode ARCH-GARCH	47
3.6.2 Evaluasi Kesalahan Peramalan	51
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	53
4.1 Statistik Deskriptif Harga Emas Kontrak Berjangka	53
4.2 Hasil Penelitian	54
4.2.1 Pembentukan Model ARCH	54
4.2.2 Pembentukan Model GARCH	59
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	64
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Saran	67

5.2.1 Aspek Teoritis	67
5.2.2 Aspek Praktis	68
DAFTAR PUSTAKA	69
LAMPIRAN	73