

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR PERSAMAAN	xv
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1.Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.1.1. Valuta Asing	
Error! Bookmark not defined.	
1.1.2. Pasar <i>Euro Dollar</i>	
Error! Bookmark not defined.	
1.1.3. Rupiah	
Error! Bookmark not defined.	
1.2.Latar Belakang Penelitian	5
1.3.Perumusan Masalah	12
1.4.Tujuan Penelitian	13
1.5.Manfaat Penelitian	14
1.5.1. Aspek Teoritis.....	14
1.5.2. Aspek Praktis	14
1.6.Sistematika Penulisan Tugas Akhir	15
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	17
2.1.Valuta Asing	17
2.2.Pasar <i>Euro Dollar</i>	19
2.3.Rupiah	20
2.4. <i>Return</i>	21

2.5.Risiko	22
2.6.Risiko Valuta Asing	23
2.7. <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i>	24
2.8. <i>Value at risk</i>	25
2.9. <i>Backtesting</i>	28
2.10.Penelitian Terdahulu	29
2.11.Kerangka Pemikiran.....	39
2.12.Hipotesis Penelitian.....	42
2.12.1.Hipotesis Penelitian Tahun 2005 dengan Derajat Kepercayaan 95%	42
2.12.2.Hipotesis Penelitian Tahun 2005 dengan Derajat Kepercayaan 99%	42
2.12.3.Hipotesis Penelitian Tahun 2008 dengan Derajat Kepercayaan 95%	42
2.12.4.Hipotesis Penelitian Tahun 2008 dengan Derajat Kepercayaan 99%	43
2.12.5.Hipotesis Penelitian Tahun 2010 dengan Derajat Kepercayaan 95%.....	43
2.12.6.Hipotesis Penelitian Tahun 2010 dengan Derajat Kepercayaan 99%	43
BAB 3 METODE PENELITIAN	45
3.1.Karakteristik Penelitian.....	45
3.2.Operasionalisasi Variabel	46
3.3.Populasi dan Sampel	48
3.3.1. Populasi	48
3.3.2. Sampel	48
3.4.Pengumpulan Data dan Sumber Data	48
3.5.Teknik Analisis Data.....	49
3.6.Pengujian Hipotesis.....	50
3.6.1. Pengujian Hipotesis Penelitian Tahun 2005 dengan Derajat Kepercayaan 95%..	50
3.6.2. Pengujian Hipotesis Penelitian Tahun 2005 dengan Derajat Kepercayaan 99%..	50
3.6.3. Pengujian Hipotesis Penelitian Tahun 2008 dengan Derajat Kepercayaan 95%..	51
3.6.4. Pengujian Hipotesis Penelitian Tahun 2008 dengan Derajat Kepercayaan 99%..	51
3.6.5. Pengujian Hipotesis Penelitian Tahun 2010 dengan Derajat Kepercayaan 95%..	51
3.6.6. Pengujian Hipotesis Penelitian Tahun 2010 dengan Derajat Kepercayaan 99%..	51
BAB 4 HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	53
4.1.Hasil Penelitian	53
4.1.1. Hasil Penelitian Tahun 2005.....	53

4.1.2. Hasil Penelitian Tahun 2008.....	68
4.1.3. Hasil Penelitian Tahun 2010.....	83
4.2. Pembahasan.....	98
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	101
5.1. Kesimpulan	101
5.2. Saran.....	102
5.2.1. Saran Untuk Praktisi	102
5.2.2. Saran Untuk Penelitian Selanjutnya	103
DAFTAR PUSTAKA	105
LAMPIRAN	
BIODATA	