

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian.....	2
1.3 Perumusan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
1.5.1 Aspek Teoritis	5
1.5.2 Aspek Praktis	6
1.6 Sistematika Penulisan	6
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Tinjauan Pustaka.....	7
2.1.1 Teori Keagenan	7
2.1.2 Derivatif	8
2.1.3 Teori Opsi	9
2.1.4 GARCH <i>Option Model</i>	11
2.1.5 <i>Interest Rate Differential</i>	12
2.1.6 Volatilitas	13
2.1.7 Strategi Opsi <i>Short Strangle</i>	13
2.1.8 Kontrak Opsi Mata Uang	14
2.2 Penelitian Terdahulu.....	15

2.3	Kerangka Pemikiran	26
BAB 3	METODE PENELITIAN.....	27
3.1	Jenis Penelitian Yang Digunakan	27
3.2	Operasional Variabel dan Skala Pengukuran	27
3.3	Populasi dan Sampel.....	28
3.3.1	Populasi 28	
3.3.2	Sampel 28	
3.4	Pengumpulan Data.....	29
3.5	Metode Analisa Data	29
BAB 4	HASIL DAN PEMBAHASAN.....	31
4.1	Hasil Penelitian.....	31
4.1.1	Hasil Perhitungan Volatilitas Historis	31
4.1.2	Hasil Perhitungan Volatilitas GARCH	32
4.1.3	Pemodelan Volatilitas	36
4.1.4	Hasil Pengujian Model.....	37
4.2	Pembahasan Hasil Penelitian.....	41
4.3	Impilkasi Penelitian	41
BAB 5	KESIMPULAN DAN SARAN.....	42
5.1	Kesimpulan	42
5.2	Saran	42
5.2.1	Bagi Penelitian Selanjutnya	42
5.2.2	Bagi Investor	43
	DAFTAR PUSTAKA	44
	BIODATA	46