

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2. Latar Belakang Penelitian	1
1.3. Perumusan Masalah	6
1.4. Tujuan Penelitian	6
1.5. Manfaat Penelitian	7
1.5.1. Manfaat Akademis.....	7
1.5.2. Manfaat Praktis.....	7
1.6. Sistematika Penulisan Tugas Akhir	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1. Teori dan Penelitian Terdahulu	9
2.1.1. Investasi	9
2.1.2. <i>Cryptocurrency</i>	9
2.1.3. Bitcoin.....	10
2.1.4. Volume Perdagangan.....	10
2.1.5. Volatilitas	10
2.1.6. <i>Return</i>	11
2.1.7. Nilai Tukar	11
2.1.8. GARCH.....	12
2.1.9. Penelitian Terdahulu	13
2.2. Kerangka Pemikiran	20

2.3. Hipotesis.....	20
BAB III METODE PENELITIAN	22
3.1. Jenis Penelitian	22
3.2. Operasional Variabel	22
3.3. Tahapan Penelitian.....	23
3.4. Populasi dan Sampel	25
3.4.1. Populasi.....	25
3.4.2. Sampel.....	25
3.5. Pengumpulan Data dan Sumber Data	25
3.6. Teknik Analisis Data	26
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	28
4.1. Statistik Deskriptif.....	28
4.2. Hasil Penelitian.....	29
4.2.1. Perbandingan Volatilitas Bitcoin dengan Mata Uang	29
4.2.2. Uji Stasioneritas.....	30
4.2.3. Uji ARMA Model.....	30
4.2.4. Uji EGARCH	31
4.3. Pembahasan Hasil Penelitian.....	32
4.3.1. Perbandingan Volatilitas Bitcoin dengan Mata Uang	32
4.3.2. Hubungan Antara Volatilitas dengan Volume Perdagangan Bitcoin... 33	
4.3.3. Hubungan Antara <i>Return</i> dengan Volume Perdagangan Bitcoin	33
4.3.4. Hubungan Antara <i>Return</i> dengan Volatilitas Bitcoin	34
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	36
5.1 Kesimpulan	36
5.2 Saran	36
5.2.1 Aspek Teoritis.....	36
5.2.2 Aspek Praktis	37
DAFTAR PUSTAKA	38
LAMPIRAN	42
Lampiran 1: Data Harga, Volume, dan <i>Return</i> Bitcoin.....	42
Lampiran 2 : Statistik Deskriptif.....	59

Lampiran 3 : Uji Stasioner <i>Augmented Dickey-Fuller</i> (ADF) Test	60
Lampiran 4 : Uji ARMA Model (1,1)	61
Lampiran 5 : Uji EGARCH (1,1).....	62