

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN	i
KATA PENGANTAR.....	ii
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
INTISARI	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Pertanyaan Penelitian	6
1.4. Tujuan Penelitian.....	7
1.5. Manfaat Penelitian.....	7
1.6. Lingkup Penelitian	8
1.7. Sistematika Penelitian	8
BAB II.....	10
2.1. Landasan Teori.....	10
2.1.1. <i>Cryptocurrencies</i>	10
2.1.2. <i>Return</i>	14
2.1.3. <i>Return</i> Pasar.....	15
2.1.4. Volume Perdagangan.....	15
2.1.5. Volatilitas.....	16
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis	16
BAB III.....	19
3.1. Desain Penelitian.....	19
3.2. Metode Pengumpulan Data	20
3.3. Metode Analisis Data	23
3.3.1. Statistik Deskriptif.....	24
3.3.2. Uji Normalitas	24
3.3.3. Uji Stasioneritas.....	25



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

**PENGARUH RETURN DAN VOLUME PERDAGANGAN TERHADAP VOLATILITAS CRYPTO INDEX
(CRIX)**

HARIS MULIYADI, I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.

Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

3.3.4. Uji Heteroskedastisitas	26
3.3.5. Analisis GARCH Model.....	26
3.3.6. <i>Wilcoxon Sign Rank Test</i>	29
BAB IV	31
4.1. Statistik Deskriptif.....	31
4.2. Uji Stasioneritas	33
4.3. Uji Heterokedastisitas	36
4.4. Uji Normalitas	36
4.5. Hasil Regresi GARCH Model.....	37
4.6. <i>Wilcoxon Sign Rank Test</i>	40
BAB V	55
5.1. Simpulan.....	55
5.2. Implikasi	56
5.3. Keterbatasan	57
5.4. Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN.....	62