



## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN MOTTO .....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	v
KATA PENGANTAR .....	vi
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiii
ABSTRAK .....	xiv
ABSTRACT.....	xv
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Batasan Masalah.....	3
1.3. Tujuan Penelitian .....	3
1.4. Tinjauan Pustaka .....	4
1.5. Metodologi Penelitian .....	5
1.6. Sistematika Penulisan .....	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	7
2.1. Virtual Currency.....	7
2.2. Bitcoin .....	13
2.3. Sentimen Investor.....	16
2.4. Google Trend Index (GTI).....	18
2.5. Peramalan.....	19
2.6. Data Time Series .....	21
2.7. Distribusi Normal dan Karakteristiknya .....	24
2.7.1. Distribusi Normal.....	24



2.7.2. Skewness .....	27
2.7.3. Kurtosis .....	29
2.7.4. Sifat Leptokurtik .....	31
2.8. Estimasi Densitas Kernel .....	31
2.9. Pengembalian (rate of return).....	35
2.10. Volatilitas .....	37
<b>BAB III KARAKTERISTIK STATISTIK &amp; PREDIKTABILITAS BTC .....</b>	<b>39</b>
3.1. Stasioner.....	39
3.2. Proses White Noise .....	43
3.3. Autoregressive Model .....	44
3.4. Fungsi Autokorelasi .....	44
3.5. Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	46
3.6. Estimasi Parameter.....	51
3.7. Uji Signifikansi Parameter .....	52
3.8. Uji Ljung Box Q-Statistics.....	53
3.9. Model Long Memory .....	54
3.9.1. Efek Long Memory dan estimasi d .....	55
3.9.2. Estimasi d menggunakan GPH .....	56
3.9.3. Uji verifikasi untuk $\hat{d}$ .....	57
3.10 Model ARIMAX. ....	58
<b>BAB IV STUDI KASUS .....</b>	<b>59</b>
4.1. Objek Penelitian .....	59
4.2. Karakteristik Data .....	59
4.3. Return dan Volatilitas Data.....	61
4.4. Sifat distribusi dan dinamis data .....	64
4.5. Prediktabilitas dan Sentimen Investor terhadap BTC .....	67
<b>BAB V PENUTUP.....</b>	<b>70</b>
5.1. Kesimpulan .....	70
5.2. Saran.....	71
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>72</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>74</b>