

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	v
ABSTRAK.....	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB 1	12
PENDAHULUAN	12
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	12
1.2 Latar Belakang Penelitian	13
1.3 Perumusan Masalah.....	25
1.4 Tujuan Penelitian.....	25
1.5 Manfaat Penelitian.....	26
1.6 Waktu dan Periode Penelitian	27
1.7 Sistematika Penulisan.....	28
BAB 2	30
TINJAUAN PUSTAKA	30
2.1 Teori-Teori dan Penelitian Terdahulu	30
2.1.1 Implikasi dari <i>Geopolitic Tension</i> dan sanksi ekonomi	30
2.1.2 Volatilitas dalam instrumen keuangan	32
2.1.3 Transmisi Volatilitas Komoditas.....	34
2.2 Kerangka Pemikiran	44
2.3 Hipotesis Penelitian.....	45
BAB 3	46
METODE PENELITIAN	46
3.1 Jenis Penelitian.....	46
3.1 Operasional Variabel.....	47
3.2 Populasi dan Sampel	47
3.4 Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	48

3.5	Tahapan Penelitian	49
3.6	Teknik Analisa Data.....	50
3.7	Keterbatasan Penelitian	57
BAB 4		58
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		58
4.1	Data Deskriptif	58
4.2	Analisa Statistik Deskriptif	58
4.2.1	Analisa Deskriptif Harga Komoditas dan Saham Energi.....	61
4.2.2	Analisa Deskriptif Harga Komoditas dan Saham non Energi.....	63
4.3	Multicolinearity Test	66
4.4	Analisa Uji Stasioner dan Transformasi Logaritma.....	68
4.5	Analisa hasil perhitungan efek <i>Spillover</i> BEKK GARCH.....	70
BAB 5		76
KESIMPULAN DAN SARAN		76
5.1	Kesimpulan.....	76
5.2	Saran.....	78
DAFTAR PUSTAKA		81