

DAFTAR ISI

| | |
|---------------------------------------|-----|
| HALAMAN JUDUL | i |
| HALAMAN PENGESAHAN I | ii |
| HALAMAN PENGESAHAN II | iii |
| KATA PENGANTAR | iv |
| ABSTRAK | v |
| ABSTRACT | vi |
| DAFTAR ISI | vii |
| DAFTAR TABEL | ix |
| DAFTAR GAMBAR | x |
| DAFTAR LAMPIRAN..... | xi |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1 Latar Belakang | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 3 |
| 1.3 Batasan Masalah..... | 3 |
| 1.4 Tujuan Penelitian | 4 |
| BAB II TINJAUAN PUSTAKA..... | 5 |
| 2.1 Obligasi | 5 |
| 2.2 Karakteristik Obligasi | 6 |
| 2.3 Rating Obligasi | 6 |
| 2.4 Risiko Investasi Obligasi | 8 |
| 2.5 Harga Obligasi | 10 |
| 2.6 Durasi Macaulay | 11 |
| 2.7 Durasi Modifikasi | 13 |
| 2.8 Durasi Eksponensial..... | 15 |
| 2.9 Konveksitas | 15 |
| 2.10 Kesalahan Relatif..... | 17 |
| BAB III METODOLOGI PENELITIAN..... | 18 |
| 3.1 Deskripsi Data..... | 18 |
| 3.2 Jenis dan Sumber Data..... | 18 |

| | | |
|----------------------------------|---|----|
| 3.3 | Variabel Penelitian | 18 |
| 3.4 | Teknik Pengambilan Sampel..... | 19 |
| 3.5 | Metode Pengumpulan Data | 19 |
| 3.6 | Metode Analisis Data | 20 |
| 3.7 | Diagram Alir | 21 |
| BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN..... | | 22 |
| 4.1 | Deskripsi Data | 22 |
| 4.2 | Analisis Aliran Kas, PV factor, dan Nilai PV | 23 |
| 4.3 | Analisis Durasi dan Konveksitas | 30 |
| 4.4 | Prediksi Harga Obligasi Berdasarkan Durasi Eksponensial tanpa Pengaruh Konveksitas | 33 |
| 4.5 | Prediksi Harga Obligasi Berdasarkan Durasi Eksponensial dengan Pengaruh Konveksitas | 35 |
| 4.6 | Kesalahan Relatif | 37 |
| BAB V PENUTUP..... | | 40 |
| 5.1 | Kesimpulan | 40 |
| 5.2 | Saran..... | 40 |
| DAFTAR PUSTAKA | | 42 |
| LAMPIRAN..... | | 45 |