

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINILITAS.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2. LatarBelakang Penelitian	3
1.3. Rumusan Masalah	7
1.4. Pertanyaan Penelitian.....	8
1.5. Tujuan Penelitian	9
1.6. Manfaat Penelitian	9
1.6.1 Aspek Teoritis	9
1.6.2 Aspek Praktis	9
1.7 Ruang Lingkup Penelitian	9
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	10

BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN	12
2.1. Tinjauan Pustaka.....	12
2.2. Kerangka Pemikiran	22
BAB III METODE PENELITIAN.....	25
3.1. Karakteristik Penelitian.....	25
3.2. Alat Pengumpulan Data.....	25
3.3. Tahapan Pelaksanaan Penelitian	26
3.4. Populasi dan Sampel.....	28
3.5. Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	29
3.6. Teknik Analisis Data.....	30
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	34
4.1. Tingkat Risiko 4 saham Bank BUMN berdasarkan Total Aset di BEI	34
4.2. Perhitungan Data <i>Return</i>	34
4.3. Perhitungan <i>Value at Risk</i> dengan simulasi Historis pada Investasi Saham ...	35
4.4. Perhitungan <i>Value at Risk</i> dengan simulasi Monte Carlo pada Investasi Saham	37
4.5. Perhitungan <i>Value at Risk</i> dengan Varians Kovarians pada Investasi Saham ..	40
4.6. Hasil Perhitungan Value at Risk	42
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	43
5.1. Kesimpulan	43
5.2. Saran	43

5.2.1. Aspek Teoritis	43
5.2.2. Aspek Praktisi	44
DAFTAR PUSTAKA	45
LAMPIRAN	48