

Daftar Isi

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.1.1 PT. Adhi Karya (Persero) Tbk	1
1.1.2 PT. Pembangunan Perumahan (Persero) Tbk	2
1.1.3 PT. Wijaya Karya (Persero) Tbk.....	2
1.1.4 PT. Waskita Karya (Persero) Tbk	2
1.1.5 PT. Duta Graha Indah Tbk	2
1.1.6 PT Surya Semesta Internusa Tbk	3
1.1.7 PT. Total Bangun Persada Tbk	3
1.2 Latar Belakang Masalah	3
1.3 Rumusan Masalah	11
1.4 Tujuan Penelitian.....	11
1.5 Kegunaan Penelitian.....	11
1.5.1 Kegunaan Teoritis	11
1.5.2 Kegunaan Praktis	11
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	13
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian	13

2.1.1	Pengertian Investasi	13
2.1.2	Pasar Modal.....	14
2.1.3	Saham.....	15
2.1.4	Harga Saham	17
2.1.5	Return Saham.....	18
2.1.6	Risiko Investasi	19
2.1.7	Manajemen Risiko	20
2.1.8	Value at Risk.....	21
2.2	Penelitian Terdahulu.....	24
2.3	Kerangka Pemikiran	36
2.4	Ruang Lingkup Penelitian	38
2.4.1	Variabel dan Sub Variabel	39
2.4.2	Lokasi dan Objek Penelitian	39
2.4.3	Waktu dan Periode Penelitian	39
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		41
3.1	Jenis Penelitian	41
3.2	Operasionalisasi Variabel.....	41
3.2.1	Variabel dan Sub Variabel	41
3.3	Tahapan Penelitian	42
3.4	Populasi dan Sampel.....	44
3.4.1	Populasi	44
3.4.2	Sampel.....	44
3.5	Pengumpulan Data.....	46
3.5.1	Jenis Data	46
3.5.2	Teknik Pengumpulan Data.....	46
3.6	Teknik Analisis Data	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		53
4.1.	Tingkat Risiko 7 Saham Konstruksi yang Listing di BEI Sejak 1 Januari 2013 Sampai 30 Agustus 2016.....	53
4.2.	Hasil Penelitian dan Pembahasan	53
4.2.1.	Perhitungan Data Return.....	53

4.2.2.	Perhitungan VaR dengan Monte Carlo Simulation.....	54
4.3.	Rekapitulasi	70
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	73
5.1	Kesimpulan.....	73
5.2	Saran	73
DAFTAR PUSTAKA		75
LAMPIRAN.....		79