

DAFTAR ISI

	Halaman
PERNYATAAN	i
ABSTRAK	ii
ABSTRACT	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
UCAPAN TERIMAKASIH.....	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penulisan	4
1.4 Manfaat Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	6
2.1 Investasi	6
2.2 Saham.....	7
2.3 <i>Return</i>	8
2.3.1 <i>ReturnRealized</i>	9
2.3.2 <i>Expected Return</i>	9
2.4 Risiko	10
2.4.1 RisikoInvestasi.....	10
2.5 Portofolio	11
2.5.1 <i>ReturnPortofolio</i>	12
2.5.2 <i>EkspektasiReturnPortofolio</i>	13

2.5.3	KovarianPortofolio	13
2.5.4	PortofolioEfisien	14
2.6	Tingkat Signifikansi	16
2.7	Penaksir Parameter	16
2.8	Sampel <i>Bootstrap</i>	17
2.8.1	Definisi <i>Bootstrap</i>	18
2.8.2	Replikasi <i>Bootstrap</i>	19
2.8.3	Prinsip <i>Plug-in</i>	19
2.8.4	Estimasi Rata-rata <i>Bootstrap</i>	20
2.8.5	EstimasiKuantil <i>Bootstrap</i>	21
2.8.6	Standar Error Sampel <i>Bootstrap</i>	21

BAB III VALUE AT RISK (VAR) DENGAN METODE BACK

SIMULATION	23
3.1 <i>Value at Risk</i>	23
3.1.1 <i>Value at Risk</i> Nonparametrik	24
3.2 <i>Value at Risk</i> denganMetodeBack Simulation	26

BAB IV STUDI KASUS 28

4.1 PT.PINDAD (persero)	28
4.2 DATA	28
4.3 <i>Return</i> Saham	30
4.4 <i>Return</i> Portofolio	31
4.5 <i>Value at Risk (VaR)</i> Portofolio	35

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN..... 37

5.1 Kesimpulan	37
5.2 Saran	38

DAFTAR PUSTAKA..... 39

LAMPIRAN 41

DAFTAR RIWAYAT HIDUP..... 58