

DAFTAR ISI

	Halaman
KATA PENGANTAR	i
UCAPAN TERIMA KASIH	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Batasan Masalah.....	2
1.3 Rumusan Masalah.....	2
1.4 Tujuan.....	3
1.5 Manfaat.....	3
BAB II LANDASAN TEORITIS	4
2.1 Saham.....	4
2.2 <i>Return</i>	4
2.3 <i>Drift</i>	6
2.4 <i>Volatility</i>	6
2.5 Investasi.....	7
2.6 Manajemen Risiko.....	7

2.7 <i>Portfolio</i>	8
2.8 Diversifikasi <i>Portfolio</i>	9
2.9 <i>Skewness</i> dan <i>Kurtosis</i>	10
2.10 Momen dan Kumulan.....	12
2.11 <i>Value At Risk</i>	13
2.12 <i>Value At Risk</i> Dengan Pendekatan Distribusi Normal.....	14
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	16
3.1 Masalah Kerugian Maksimum.....	16
3.2 Teori Dasar.....	16
3.3 Pengembangan Teori.....	16
3.4 Penerapan.....	16
3.5 Konstruksi Program Aplikasi.....	17
3.6 Validasi.....	17
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	18
4.1 <i>Value At Risk</i> Pendekatan Ekspansi Cornish-Fisher.....	18
4.2 Program Aplikasi.....	20
4.3 Sumber Data.....	22
4.4 Implementasi Program Aplikasi.....	23
4.5 Validasi Program.....	24
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	27
5.1 Kesimpulan.....	27
5.2 Saran.....	28
DAFTAR PUSTAKA	29

LAMPIRAN 1	30
LAMPIRAN 2	39
LAMPIRAN 3	48
LAMPIRAN 4	51
LAMPIRAN 5	53
RIWAYAT HIDUP	56

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kriteria <i>Skewness</i>	11
Gambar 2.2 Kriteria <i>Kurtosis</i>	11
Gambar 4.1 Rancangan Tampilan Aplikasi Program.....	21
Gambar 4.2 Tampilan <i>User</i> Aplikasi Program.....	23
Gambar 4.3 Implementasi Studi Kasus Pada Program Aplikasi.....	23

DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1 Nilai Kuantil Bawah Distribusi Normal.....	20
Tabel 4. 2 Nilai <i>Mean</i> , standar deviasi, <i>skewness</i> , dan <i>kurtosis</i> studi kasus.....	25