

# Daftar Isi

<b>LEMBAR PENGESAHAN.....</b>	<b>2</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN .....</b>	<b>1</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>I</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>II</b>
<b>LEMBAR PERSEMBAHAN .....</b>	<b>III</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>IV</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>V</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>VII</b>
<b>DAFTAR TABEL.....</b>	<b>VIII</b>
<b>DAFTAR ISTILAH .....</b>	<b>IX</b>
<b>BAB I.....</b>	<b>1</b>
<b>PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1. LATAR BELAKANG .....	1
1.2. PERUMUSAN MASALAH.....	1
1.3. BATASAN MASALAH.....	1
1.4. TUJUAN PENELITIAN.....	2
1.5. METODOLOGI PENYELESAIAN MASALAH .....	2
1.6. SISTEMATIKA PENULISAN.....	2
<b>BAB II .....</b>	<b>4</b>
<b>LANDASAN TEORI.....</b>	<b>4</b>
2.1. INVESTASI.....	4
2.2. RETURN .....	5
2.3. EXPECTED RETURN.....	6
2.4. RISIKO .....	6
2.5. PORTOFOLIO .....	7
2.6. EKSPETASI RETURN PORTOFOLIO .....	8
2.7. RISIKO PORTOFOLIO .....	8
2.8. LQ45 .....	9
2.9. METODE VALUE AT RISK.....	9
2.9.1 Pendekatan Simulasi Historis .....	9
2.9.2 Pendekatan Varian - Kovarian .....	10
2.9.3. Pendekatan Simulasi Monte Carlo.....	13
2.10. TINGKAT KEPERCAYAAN .....	14
2.11. ANALISIS VARIAN (ANOVA) .....	14
2.10. MEDIAN ABSOLUT DEVIATION.....	16
<b>BAB III.....</b>	<b>17</b>
<b>METODE PENELITIAN .....</b>	<b>17</b>
3.1. DESKRIPSI SISTEM PENELITIAN .....	17
3.2. PERANCANGAN SISTEM .....	17
3.2. SISTEM PERBANDINGAN WAKTU EKSEKUSI .....	18
3.3. SISTEM PERHITUNGAN VALIDASI PADA METODE SIMULASI MONTE CARLO DAN VARIAN - KOVARIAN .....	19
<b>BAB IV.....</b>	<b>21</b>

<b>ANALISIS HASIL PERHITUNGAN.....</b>	<b>21</b>
4.1. PERHITUNGAN NILAI VAR.....	21
4.1.1. Analisis Nilai VaR.....	25
4.1.2. Analisis Nilai VaR dengan Metode Varian - Kovarian.....	25
4.1.3. Analisis Nilai Var dengan Metode Simulasi Monte Carlo.....	28
4.2. WAKTU PERHITUNGAN.....	29
4.3. VALIDASI NILAI VAR.....	30
4.3.1. Validasi Simulasi Monte Carlo dan Varian - Kovarian.....	30
4.3.2. Hasil dan Analisis Validasi pada kedua model.....	33
4.3. HASIL UJI ANOVA.....	34
<b>BAB V.....</b>	<b>36</b>
<b>KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>36</b>
5.1. KESIMPULAN.....	36
5.2. SARAN.....	37
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>38</b>
<b>LAMPIRAN A: DATA SAHAM LQ45.....</b>	<b>39</b>