

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Batasan Masalah.....	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Metode Penelitian.....	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Pasar Keuangan.....	8
2.2 Investasi	13
2.3 Komoditas	16
2.4 Risiko	17
2.5 <i>Return</i>	19
2.6 Ukuran Sebaran Data.....	22
2.7 Volatilitas	23
2.8 Perdagangan Emas Berjangka	25
2.9 Distribusi Normal.....	27
2.10 Tingkat Kepercayaan.....	31
2.11 Metode Simulasi Monte Carlo.....	33

BAB III PERHITUNGAN VALUE AT RISK PERDAGANGAN EMAS BERJANGKA DENGAN ASUMSI DISTRIBUSI LOG-NORMAL MENGGUNAKAN METODE SIMULASI MONTE CARLO.....	35
3.1 <i>Value at Risk</i> (VaR).....	35
3.2 Distribusi Log- Normal	38
3.3 Aplikasi Metode Simulasi Monte Carlo untuk Estimasi <i>Value at Risk</i> (VaR) dengan Nilai <i>Return</i> yang Diasumsikan Berdistribusi Log-Nomal.....	40
3.4 <i>Backtesting</i>	41
BAB IV STUDI KASUS DAN ANALISA	44
4.1 Hasil Perhitungan VaR Perdagangan Emas Berjangka Dengan Asumsi Distribusi Log-Normal Menggunakan Metode Simulasi Monte Carlo	44
4.2 Pembahasan.....	78
BAB V PENUTUP	86
5.1 Kesimpulan	86
5.2 Saran	87
DAFTAR PUSTAKA	88
LAMPIRAN	

