

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Perusahaan Rokok yang terdaftar di BEI	1
Tabel 1.2 Rangkaing Perusahaan terbesar 2015 di Indonesia berdasarkan net profit	3
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	30
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian	36
Tabel 4.1 Deskripsi statistik saham GGMR dan HMSP 1 September 2014 sampai 1 September 2016	47
Tabel 4.2 Nilai VaR Simulasi Historis Gudang Garam dan HM Sampoerna September 2014 sampai September 2016	50
Tabel 4.3 Perhitungan rata-rata dan standar deviasi dari <i>return</i> Gudang Garam dan HM Sampoerna 1 September 2014 sampai 1 September 2016	51
Tabel 4.4 Nilai perhitungan VaR Simulasi Monte Carlo Gudang Garam dan HM Sampoerna September 2014 sampai September 2016	53
Tabel 4.5 Hasil Perhitungan VaR	54