



Perhitungan nilai VAR terhadap Portofolio-portofolio optimal yang dihasilkan dengan metode Markowitz dan Mean-Absolute Deviation

SETIAWAN, Arie Andika, Dr. R. Agus Sartono, MBA

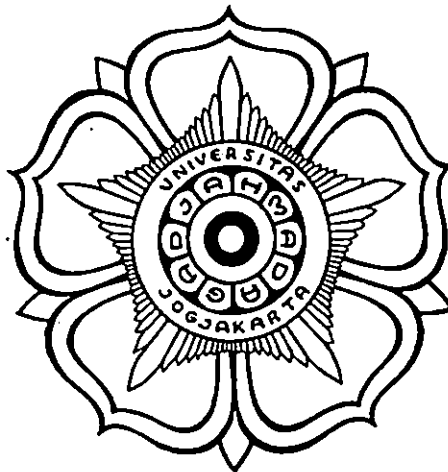
Universitas Gadjah Mada, 2004. Disetujui dan Dinyatakan Layak oleh D.A. 0902.01

**PERHITUNGAN NILAI VAR TERHADAP PORTOFOLIO-  
PORTOFOLIO OPTIMAL YANG DIHASILKAN DENGAN METODE  
MARKOWITZ DAN MEAN-ABSOLUTE DEVIATION**

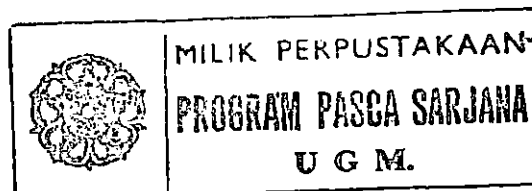
Tesis

untuk memenuhi sebagian persyaratan  
mencapai derajat Sarjana S-2

Program Studi Magister Manajemen  
Jurusan Ilmu-ilmu Sosial



diajukan oleh  
**Arie Andika Setiawan**  
10454/PS/MM/02



Kepada  
**SEKOLAH PASCASARJANA  
UNIVERSITAS GADJAH MADA  
2004**

MILIK PERPUSTAKAAN PASCASARJANA UGM 499
INV : 0170 /H/2005
LABEL : MM
SUBJ: Per Md - Portofolio
Optimal - LQ45

7.53



Perhitungan nilai VAR terhadap Portofolio-portofolio optimal yang dihasilkan dengan metode Markowitz dan Mean-Absolute Deviation  
Arie Andika, Dr. R. Agus Sartono, MBA  
Mada, 2004 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

## LEMBAR PENGESAHAN

### PERHITUNGAN NILAI VAR TERHADAP PORTOFOLIO- PORTOFOLIO OPTIMAL YANG DIHASILKAN DENGAN METODE MARKOWITZ DAN *MEAN-ABSOLUTE DEVIATION*

yang dipersiapkan dan disusun oleh  
**Arie Andika Setiawan**  
10454/PS/MM/02  
telah dipertahankan di depan Dewan Penguji  
pada tanggal 8 Desember 2004  
dan dinyatakan telah lulus memenuhi syarat

Yogyakarta, 8 Desember 2004

Dosen Penguji I

Dr. Mamduh Hanafi, MBA.

Dosen Penguji II

Dr. R. Agus Sartono, MBA.

Dosen Pembimbing

Dr. R. Agus Sartono, MBA.