

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
ABSTRAK	x
ABSTRACT	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Pertanyaan Penelitian	8
1.4 Tujuan Penelitian	8
1.5 Manfaat Penelitian	9
1.6 Lingkup Penelitian	9
BAB II LANDASAN TEORI	11
2.1 Investasi	11
2.2 Return dan Risiko	11
2.3 Diversifikasi	12
2.4 Portofolio	13
2.5 Aset Saham	14
2.6 Aset Kripto	15
2.7 Pengaruh Diversifikasi Aset Kripto	16
2.8 Kajian Penelitian Terdahulu	17
BAB III METODE PENELITIAN	22
3.1 Desain Penelitian	22
3.2 Metode Pengumpulan Data	22
3.2.1 Data dan Sampel	22

3.2.2	Teknik Pengambilan Sampel.....	23
3.3	Definisi Operasional Variabel	23
3.3.1	Aset Kripto	23
3.3.2	Aset Saham	24
3.3.3	Return Realisasian.....	24
3.3.4	Return Ekspektasian.....	24
3.3.5	Standar Deviasi	25
3.3.6	Varian.....	25
3.3.7	Rasio Sharpe	25
3.3.8	Rasio Sortino.....	26
3.3.9	Rasio Calmar.....	27
3.4	Metode Analisis Data	28
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		30
4.1	Statistik Deskriptif.....	30
4.2	Korelasi antar Aset	31
4.3	Portofolio Acak	33
4.3.1	Kinerja Portofolio Acak	36
4.4	Portofolio Optimal.....	40
4.4.1	Kinerja Portofolio Optimal	42
4.5	Pembahasan	44
4.5.1	Pembahasan Portofolio Acak	46
4.5.2	Pembahasan Portofolio Optimal	47
4.5.3	Perbandingan Portofolio Acak dan Portofolio Optimal	49
BAB V SIMPULAN		51
5.1	Simpulan.....	51
5.2	Keterbatasan Penelitian	52
5.3	Saran	52
DAFTAR PUSTAKA		54