

## DAFTAR ISI

	Hal
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
INTISARI.....	iv
<i>ABSTRACT</i> .....	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
I. PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Perumusan Masalah.....	3
1.3. Tujuan Penelitian.....	3
1.4. Sistematika Pembahasan.....	4
II. KONSEP DAN TEORI.....	6
2.1. Investasi.....	6
2.1.1. Pengertian Investasi.....	6
2.1.2. Alternative Investasi.....	6
2.1.3. Proses Investasi.....	7
2.2. Risiko Portofolio.....	9
2.2.1. Pengertian Portofolio.....	9
2.2.2. Tingkat Pengembalian.....	10
2.2.3. Tingkat Risiko.....	11
2.2.4. Sumber Risiko.....	12
2.3. Metode Value at Risk.....	14
2.3.1. Definisi Value at Risk.....	14
2.3.2. Perhitungan VaR.....	15
2.3.3. Metode Delta Normal.....	16

III. METODOLOGI PENELITIAN.....	18
3.1. Data.....	18
3.2. Metode Analisis.....	18
IV. DATA ANALISIS.....	25
4.1. Hasil Perhitungan.....	27
V. KESIMPULAN DAN SARAN.....	31
5.1. Kesimpulan.....	31
5.2. Saran.....	32
DAFTAR PUSTAKA.....	33
LAMPIRAN.....	34

## DAFTAR TABEL

		hal
Tabel 4	Nama-nama saham di setiap Portofolio.....	25
Tabel 4.1.1	Hasil akhir Portofolio Optimal dengan menggunakan risiko yang berbeda dan Coefficient of Variation dengan kedua risiko....	28
Tabel 4.1.2	Hasil Output Paired Samples Statistics.....	28
Tabel 4.1.3	Hasil Output Paired Samples Correlations.....	29
Tabel 4.1.4.	Hasil Output Paired Samples Test.....	29

## DAFTAR GAMBAR

	hal
Gambar 2.1 Hubungan Risiko Sistematis dan tidak	
Sistematis dengan Total Risiko.....	12
Gambar 4.1 Hasil dari t Table dan t Hitung.....	30

## DAFTAR LAMPIRAN

	<b>hal</b>
Lampiran 1. Bulan Juli 2002.....	34
Lampiran 2. Bulan Agustus 2002.....	36
Lampiran 3. Bulan September 2002.....	40
Lampiran 4. Bulan Oktober 2002.....	43
Lampiran 5. Bulan November 2002.....	48
Lampiran 6. Bulan Desember 2002.....	56
Lampiran 7. Bulan Januari 2003.....	65
Lampiran 8. Bulan Februari 2003.....	68
Lampiran 9. Bulan Maret 2003.....	74
Lampiran 10. Bulan April 2003.....	80
Lampiran 11. Bulan Mei 2003.....	88
Lampiran 12. Bulan Juni 2003.....	96