

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	I
HALAMAN PENGESAHAN	II
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	III
KATA PENGANTAR	III
DAFTAR ISI.....	V
DAFTAR TABEL.....	VI
DAFTAR GAMBAR	VI
ABSTRAK.....	VII
ABSTRACT.....	VIII
BAB I PENDAHULUAN.....	9
1.1 Pendahuluan.....	9
1.2 Rumusan Masalah.....	13
1.3 Tujuan Penelitian	15
1.4 Motivasi Penelitian	15
1.5 Manfaat Penelitian	16
1.6 Kontribusi Penelitian	17
1.7 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	17
1.8 Sistematika Penulisan	18
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	20
2.1 Landasan Teori.....	20
2.2 Tinjauan Pustaka	34
BAB III METODE PENELITIAN	36
3.1 Desain Penelitian	36
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	36
3.3 Populasi dan Sampel	37
3.4 Instrumen Penelitian	38
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	38
3.6 Teknik Analisis Data.....	39
BAB IV PEMBAHASAN.....	45
4.1 Deskripsi Data.....	45

4.2	Pembahasan.....	57
BAB V SIMPULAN		63
5.1	Simpulan	63
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	65
5.3	Implikasi Penelitian	66
5.4	Rekomendasi Penelitian Selanjutnya.....	67
BAB VI DAFTAR PUSTAKA.....		68
BAB VII LAMPIRAN		71
7.1	Lampiran 1: Sampel Simulasi Top 50 Sharpe Ratio.....	71
7.2	Lampiran 2: Sampel Simulasi Bottom 50 Sharpe Rasio.....	72
7.3	Lampiran 3: Tampilan Code Python.....	73
7.4	Lampiran 4: Hasil Uji ANOVA dan Post Hoc Tes.....	73

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Statistik deskriptif aset individual.....	45
Tabel 4.2	Koefisien Korelasi Antar Aset.....	47
Tabel 4.3	Simpulan Simulasi Portofolio	49
Tabel 4.4	Top 20 Sharpe Rasio Portofolio Simulasi Monte Carlo	51
Tabel 4.5	Kinerja Portofolio pada Periode Non-Pandemi dan Pandemi COVID-19..	54
Tabel 4.6	Hasil Uji ANOVA Periode 2011 – 2025.....	56
Tabel 4.7	Hasil Post Hoc Tukey HSD Gold-Bitcoin (2011 - 2025).....	56
Tabel 4.8	Hasil Post Hoc Tukey HSD Seluruh Portofolio (2011 - 2025)	56
Tabel 4.9	Hasil Uji ANOVA Periode Pandemi vs Non-Pandemi.....	57

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	<i>Assets Cumulative Return</i> 2011 - 2025	11
Gambar 4.1	Distribusi Risiko dan Return Portofolio Hasil Simulasi Monte Carlo	52