



DAFTAR ISI

Lembar Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	ix
Daftar Gambar	x
Intisari	xi
<i>Abstract</i>	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	6
1.7 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Tinjauan Pustaka	8
2.2 Teori Dasar/Landasan Teori	10
2.2.1 Investasi	10



2.2.1.1 Pengertian Investasi	10
2.2.1.2 Proses Investasi	11
2.2.2 Dasar Keputusan Investasi	13
2.2.2.1 <i>Return</i>	13
2.2.2.2 Risk (Risiko)	14
2.2.2.3 Matematika Portofolio	17
2.2.2.3.1 Varian	17
2.2.2.3.2 Deviasi Standar	18
2.2.2.3.3 Koefisien Korelasi	18
2.2.2.3.4 Kovarian	19
2.2.3 Portofolio	21
2.2.3.1 Pengertian Portofolio	21
2.2.3.2 Diversifikasi	21
2.2.3.3 Portofolio Efisien dan Optimum	22
2.2.4 Model Portofolio Markowitz	23
2.2.4.1 Sejarah	23
2.2.4.2 Diversifikasi Markowitz	24
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	26
3.1 Sumber Data	26
3.2 Metode Analisis Data	27
3.2.1 Metode Markowitz	27
3.2.2 Menghitung Rata-rata <i>Return</i> dan Deviasi Standar	28
3.2.3 Membuat Matrix Korelasi	29



3.2.4 Membuat Matriks Kovarian	30
3.2.5 Membuat Matriks Varian Portofolio	31
3.2.6 Membuat <i>Return</i> dan Deviasi Standar Portofolio dan Mencari Komposisi Portofolio	31
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	34
4.1 Pembahasan	34
4.2 Perhitungan Portofolio	34
4.2.1 Portofolio Negara Indonesia	36
4.2.2 Portofolio Negara Malaysia	39
4.2.3 Portofolio Negara Singapura	41
4.2.4 Portofolio Negara Thailand	44
4.2.5 Portofolio Sektor Industri Keuangan	47
4.2.6 Portofolio Sektor Industri Perindustrian	50
4.2.7 Portofolio Sektor Industri Energi	53
4.2.8 Portofolio Sektor Industri Properti	55
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	59
5.1 Kesimpulan	59
5.2 Saran	60
DAFTAR PUSTAKA	62



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Daftar emiten negara Indonesia	63
Tabel 4.2 Komposisi portofolio optimum negara Indonesia	64
Tabel 4.3 Daftar emiten negara Malaysia	65
Tabel 4.4 Komposisi portofolio optimum negara Malaysia	66
Tabel 4.5 Daftar emiten negara Singapura	67
Tabel 4.6 Komposisi portofolio optimum negara Singapura	68
Tabel 4.7 Daftar emiten negara Thailand	69
Tabel 4.8 Komposisi portofolio optimum negara Thailand	70
Tabel 4.9 Daftar emiten sektor industri keuangan	71
Tabel 4.10 Komposisi portofolio optimum sektor industri keuangan	72
Tabel 4.11 Daftar emiten sektor industri perindustrian	73
Tabel 4.12 Komposisi portofolio optimum sektor industri perindustrian	74
Tabel 4.13 Daftar emiten sektor industri energi	75
Tabel 4.14 Komposisi portofolio optimum sektor industri energi	76
Tabel 4.15 Daftar emiten sektor industri properti	77
Tabel 4.16 Komposisi portofolio optimum sektor industri properti	78



DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1 Komposisi portofolio optimum negara Indonesia	38
Gambar 4.2 Komposisi portofolio optimum negara Malaysia	41
Gambar 4.3 Komposisi portofolio optimum negara Singapura	44
Gambar 4.4 Komposisi portofolio optimum negara Thailand	47
Gambar 4.5 Komposisi portofolio optimum sektor industri keuangan	49
Gambar 4.6 Komposisi portofolio optimum sektor industri perindustrian	52
Gambar 4.7 Komposisi portofolio optimum sektor industri energi	55
Gambar 4.8 Komposisi portofolio optimum sektor industri properti	57