



DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Persetujuan.....	ii
Lembar Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi.....	v
Daftar Gambar.....	viii
Daftar Tabel.....	ix
Daftar Lampiran.....	x
Intisari.....	xi
<i>Abstract</i>	xii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang.....	1
B. Perumusan Masalah.....	6
C. Tujuan Penelitian.....	8
D. Batasan Penelitian.....	8
E. Manfaat Penelitian.....	8
F. Sistematika Penulisan.....	9
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Definisi Investasi.....	11
B. Instrumen Investasi.....	12
B.1 Instrumen Pasar Modal.....	12
B.2 Instrumen Pasar Uang.....	20
C. Risiko Investasi.....	22
D. Portofolio Investasi.....	25



E. Teori Portofolio Markowitz.....	28
F. Telaah Pustaka.....	31
BAB III PROFIL PERUSAHAAN	
A. Sejarah Singkat Perusahaan.....	33
B. Produk Perusahaan.....	34
B.1 Produk Korporasi.....	35
B. 2 Produk Unggulan Ritel.....	37
C. Kinerja Perusahaan Kurun Waktu 5 Tahun Terakhir.....	40
BAB IV METODE PENELITIAN	
A. Metode Analisis.....	46
B. Tahapan Penelitian.....	46
C. Menentukan <i>Return</i>	46
D. Menentukan Standar Deviasi.....	47
E. Menentukan <i>Covariance</i>	48
F. Menentukan Koefisien Korelasi.....	49
G. Menentukan Portofolio Investasi.....	49
BAB V ANALISIS DAN PEMBAHASAN	
A. Instrumen Investasi Pembentuk Portofolio.....	51
B. <i>Return</i> dan Standar Deviasi.....	51
C. Menentukan <i>Covariance</i> dan Koefisien Korelasi.....	54
D. Perhitungan Bobot Instrumen Investasi.....	54
E. Kurva <i>Efficient Frontier</i>	56



BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan.....	59
B. Saran.....	60
DAFTAR PUSTAKA.....	61



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2-1 Kurva <i>Efficient Frontier</i>	31
Gambar 3-1 Pendapatan Premi Bruto PT. Asuransi Jasa Indonesia Tahun 2003 – 2007.....	40
Gambar 3-2 Klaim Bruto PT. Asuransi Jasa Indonesia Tahun 2003- 2007...41	
Gambar 3-3 Hasil Underwriting Netto PT. Asuransi Jasa Indonesia 2003-2007.....	42
Gambar 3-4 Earning Before Tax PT. Asurasi X 2003 – 2007.....	43
Gambar 3-5 Net Profit PT. Asuransi Jasa Indonesia 2003- 2007.....	43
Gambar 3-6 Investasi (Non Konsolidasi).....	44
Gambar 3-7 Hasil Investasi (Non Konsolidasi).....	45
Gambar 3-8 Risk Based Capital 2003- 2007.....	45
Gambar 5-1 Risk & Return Instrumen Investasi Tahun 2003-2007.....	53
Gambar 5-2 Kurva Efficient Frontier Portfolio Usulan.....	56



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis optimalisasi portofolio investasi pada PT Asuransi Jasa Indonesia
ADHAWIAH, Sofia Ratna, Irwan Taufik Ritonga, SE., M.Bus
Universitas Gadjah Mada, 2008 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Perincian Jumlah Investasi Dalam Industri Asurasni Tahun 2006.....	5
Tabel 5.1	Return dan Standar Deviasi Instrumen Investasi Periode Tahun 2003-2007.....	53



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1.	Komposisi Investasi	
	PT. Asuransi Jasa Indonesia Tahun 2003-2007.....	63
Lampiran 2.	Hasil Investasi	
	PT. Asuransi Jasa Indonesia Tahun 2003-2007.....	64
Lampiran 3	Tingkat Pengembalian Instrumen Investasi	
	Tahun 2003 -2007.....	65
Lampiran 4.	Standar Deviasi Instrumen Investasi	
	Tahun 2003-2007.....	66
Lampiran 5.	Matriks Koefisien Korelasi.....	67
Lampiran 6.	Matriks Covariance.....	68
Lampiran 7.	Komposisi Portofolio Usulan – Markowitz Model	
	Tahun 2003-2007.....	69