



Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	v
Daftar Tabel	vii
Daftar Gambar	viii
Daftar Lampiran	ix
Intisari	x
Abstract	xi
BAB I : PENGANTAR	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	5
1.3. Tujuan dan Manfaat Penelitian	6
1.4. Organisasi Penelitian	6
BAB II : TINJAUAN PUSTAKA	7
2.1. Risiko	7
2.1.1. Metode Markowitz	9
2.1.2. Metode Single Index Model	11
2.2. Perhitungan Kinerja Portfolio	13
2.2.1. Coefficient of Variation	13
2.2.2. Treynor Measure	14
2.2.3. Sharpe Ratio	14
2.2.4. Jensen Alpha	15
2.3. Perumusan Hipotesis	16
BAB III : METODE PENELITIAN	18
3.1. Jenis Penelitian	18
3.2. Data Penelitian	18
3.3. Populasi Penelitian	19
3.4. Metode Uji Statistik	21
3.5. Alur Penelitian	22



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Perbandingan kinerja portofolio yang terdiri atas saham komoditas dalam LQ 45 dan saham Unilever terhadap kinerja IHSG

KUNCORO, Henry, Supriyadi, Dr., M.Sc

Universitas Gadjah Mada, 2010. Di unduh dari http://eprints.ugm.ac.id/

BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	23
4.1. Analisa Hasil Penelitian	23
4.1.1. Pengujian Hipotesis	23
4.1.2. Analisa Hasil Perhitungan Metode CV dan Sharpe Ratio	25
4.1.3. Analisa Hasil Perhitungan Metode Treynor Measure dan Jensen Alpha.	29
BAB V : KESIMPULAN	32
5.1. Kesimpulan	32
5.2. Keterbatasan Penelitian	32
5.3. Saran	33
Daftar Pustaka	34
Lampiran	