

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv

BAB I PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang	1
1.2.Rumusan Masalah	4
1.3.Tujuan Penelitian	5
1.4.Batasan Masalah	5

BAB II TINJAUAN KEPUSTAKAAN & LANDASAN TEORI

2.1. Tinjauan Pustaka	6
2.1.1. Dana Pensiun Pegadaian	6
2.2. Landasan Teori	8

2.2.2. Portofolio	12
2.2.2.1. Tingkat Pengembalian (<i>return</i>)	14
2.2.2.2. Risiko Portofolio	15
2.2.2.3. <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM)	16
2.2.2.3.1. <i>Capital Market Line</i> (CML)	18
2.2.2.3.2. <i>Security Market Line</i> (SML)	18
2.2.2.4. Evaluasi Kinerja Portofolio	20

BAB III METODE PENELITIAN

3.1. Desain Penelitian	23
3.1.1. Teknik Pengumpulan Data	23
3.2. Metode Analisis dan Pengolahan Data	23
3.2.1. Menghitung Return Portofolio	23
3.2.2. Menghitung Standar Deviasi	25
3.2.3. Menghitung Beta Portofolio	26
3.2.4. Melakukan Evaluasi Kinerja Portofolio	26

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1. Analisis Data	29
4.1.1. Data Investasi	30
4.1.1.1. Data Investasi Saham	31

4.1.1.2. Data Investasi Reksadana	35
4.1.2. Pengukuran Kinerja	36
4.1.2.1. Pengukuran Kinerja Portofolio Saham	37
4.1.2.2. Pengukuran Kinerja Reksadana	38
4.2. Pembahasan	40
4.2.1. <i>Risk Adjusted Performance</i>	40
4.2.1.1. Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode Sharpe....	41
4.2.1.2. Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode Treynor ..	45
4.2.1.3. Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode Jensen ...	48
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Kesimpulan	52
5.2. Saran	53
DAFTAR PUSTAKA	54