

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI	xvi
ABSTRACT	xvii
BAB I. PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Tujuan Penelitian	2
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA	4
A. Tinjauan Pustaka	4
1. <i>Dollar cost averaging</i>	4
2. <i>Risk adjusted performance</i>	6
3. <i>Value at Risk</i>	7
4. <i>Time horizon</i>	8

B. Landasan Teori	8
BAB III. METODA PENELITIAN	13
A. Bahan Penelitian	13
B. Pengumpulan Data	13
C. Langkah Penelitian	14
1. Tahap I	14
a. Penghitungan return tahunan IHSG menggunakan metoda DCA interval bulanan	14
b. Penghitungan <i>Return</i> tahunan IHSG dengan metoda DCA interval kuartalan	15
c. Penghitungan <i>return</i> tahunan pasar yang diwakili oleh pertumbuhan IHSG tanpa perlakuan metoda DCA (<i>Lump Sum</i>)	15
d. Penentuan perioda <i>bullish</i> dan <i>bearish</i>	16
e. Pengujian Statistik	16
f. Penghitungan rata-rata return, Deviasi Standar, Sharpe Ratio, dan VAR	17
2. Tahap II	18
3. Tahap III	18
BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Return	20

1. Return tahunan dan deviasi standar	20
2. Rata-rata return tahunan pada perioda bullish dan bearish	28
B. Hubungan Return dan Risiko	33
C. Hubungan Return dan <i>Time Horizon</i>	35
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan	39
B. Saran	39
DAFTAR PUSTAKA	40