

## DAFTAR ISI

Lembar Pengesahan.....	ii
Lembar Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	viii
Daftar Gambar.....	ix
Daftar Lampiran.....	x
Abstrak.....	xi
 <b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	 <b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	2
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	3
1.4 Tujuan Penelitian.....	4
1.5 Manfaat Penelitian.....	4
1.6 Lingkup Penelitian .....	4
1.7 Sistematika Penulisan.....	5
 <b>BAB II LANDASAN TEORI.....</b>	 <b>6</b>
2.1 Investasi.....	6
2.2 Return.....	9
2.3 Risiko.....	10
2.4 Diversifikasi.....	12
2.5 Portofolio.....	13
2.5.1 Portofolio Efisien.....	14
2.5.2 Portofolio Optimal.....	16

2.5.3	Return Portofolio.....	17
2.5.4	Risiko Portofolio.....	18
2.6	Ukuran Kinerja Portofolio.....	19
2.7	POJK no. 1/POJK.05/2016.....	20
2.8	Penelitian Terdahulu.....	20
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>		<b>22</b>
3.1	Rancangan Penelitian.....	22
3.2	Metode Pengumpulan Data.....	22
3.3	Metode Analisa Data.....	22
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>27</b>
4.1	Portofolio Investasi Aktual.....	27
4.2	Portofolio Optimal.....	28
4.2.1	Portofolio Optimal Skenario 1.....	29
4.2.2	Portofolio Optimal Skenario 2.....	32
4.2.3	Portofolio Optimal Skenario 3.....	35
4.3	Strategi Penggeseran Portofolio.....	38
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>		<b>40</b>
5.1	Kesimpulan.....	40
5.2	Keterbatasan.....	41
5.3	Saran.....	42
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>		<b>43</b>

## **DAFTAR TABEL**

Tabel 4.1	Return dan risiko portofolio skenario 1.....	30
Tabel 4.2	Return dan risiko portofolio skenario 2.....	32
Tabel 4.3	Return dan risiko portofolio skenario 3.....	35

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Jenis sekuritas.....	7
Gambar 2.2	Efficient frontier set.....	15
Gambar 2.3	Portofolio optimal.....	17
Gambar 4.1	Portofolio aktual.....	27
Gambar 4.2	Portofolio optimal skenario 1.....	30
Gambar 4.3	Komposisi portofolio optimal skenario 1.....	31
Gambar 4.4	Portofolio optimal skenario 2.....	33
Gambar 4.5	Komposisi portofolio optimal skenario 2.....	34
Gambar 4.6	Portofolio optimal skenario 3.....	36
Gambar 4.7	Komposisi portofolio optimal skenario 3.....	37

## **DAFTAR LAMPIRAN**

Lampiran 1	Komposisi Portofolio Skenario 1.....	45
Lampiran 2	Komposisi Portofolio Skenario 2.....	47
Lampiran 3	Komposisi Portofolio Skenario 3.....	49