

**PENERAPAN METODE EXPONENTIALLY WEIGHTED MOVING
AVERAGE (EWMA) DAN METODE SEMI VARIANS (SV) DALAM
PERHITUNGAN RISIKO PORTOFOLIO SAHAM OPTIMAL**

(Studi Kasus Dana Pensiun PT. Pindad Persero)

SKRIPSI

**Diajukan untuk Memenuhi Sebagian dari Syarat untuk
Memperoleh Gelar Sarjana Sains Bidang Matematika**



Oleh

Faizal Rachman

1005225

**DEPARTEMEN PENDIDIKAN MATEMATIKA
FAKULTAS PENDIDIKAN MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS PENDIDIKAN INDONESIA**

2014

FAIZAL RACHMAN

**PENERAPAN METODE EXPONENTIALLY WEIGHTED MOVING AVERAGE
(EWMA) DAN METODE SEMI VARIANS (SV) DALAM PERHITUNGAN RISIKO
PORTOFOLIO SAHAM OPTIMAL
(Studi Kasus Dana Pensiun PT. Pindad Persero)**

DISETUJUI DAN DISAHKAN OLEH:

Pembimbing I

Dewi Rachmatin, S.Si., M.Si.
NIP : 196909291994122001

Pembimbing II

Dra. Entit Puspita, M.Si.
NIP : 196704081994032002

Mengetahui,
Ketua Departemen Pendidikan Matematika

Drs. Turmudi, M.Ed., M.Sc., Ph.D.
NIP : 196101121987031003

**PENERAPAN METODE EXPONENTIALLY WEIGHTED MOVING AVERAGE
(EWMA) DAN METODE SEMI VARIANS (SV) DALAM PERHITUNGAN RISIKO
PORTOFOLIO SAHAM OPTIMAL
(Studi Kasus Dana Pensiun PT. Pindad Persero)**

Oleh
Faizal Rachman

Sebuah skripsi yang diajukan untuk memenuhi salah satu syarat untuk memperoleh gelar
Sarjana Sains pada
Fakultas Pendidikan Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam

© Faizal Rachman 2014
Universitas Pendidikan Indonesia
Oktober 2014

Hak Cipta dilindungi undang-undang.
Skripsi ini tidak boleh diperbanyak seluruhnya atau sebagian,
dengan dicetak ulang, difoto kopi, atau cara lainnya tanpa ijin dari penulis.

PERNYATAAN

Dengan ini saya menyatakan bahwa skripsi yang berjudul “PENERAPAN METODE EXPONENTIALLY WEIGHTED MOVING AVERAGE (EWMA) DAN METODE SEMI VARIANS (SV) DALAM PERHITUNGAN RISIKO PORTOFOLIO SAHAM OPTIMAL (Studi Kasus Dana Pensiun PT. Pindad Persero)” ini dan seluruh isinya adalah benar-benar karya saya sendiri, dan saya tidak melakukan penjiplakan atau pengutipan dengan cara-cara yang tidak sesuai dengan etika ilmu yang berlaku dalam masyarakat keilmuan. Atas pernyataan tersebut, saya siap menanggung risiko yang dijatuhkan kepada saya apabila dikemudian hari ditemukan adanya pelanggaran terhadap etika keilmuan dalam karya ini, atau ada klaim dari pihak lain terhadap karya saya.

Bandung, Oktober 2014

Yang membuat pernyataan,

Faizal Rachman