

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	iii
HALAMAN MOTTO	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI.....	xiii
ABSTRACT.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Batasan Masalah	2
1.3 Tujuan Penelitian	3
1.4 Tinjauan Pustaka.....	3
1.5 Metode Penelitian	5
1.6 Sistematika Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1 Variabel Random	7
2.2 Harga Harapan, Variansi dan Kovariansi Variabel Random.....	8
2.3 Matriks.....	10
2.3.1 Definisi matriks	10
2.3.2 Transpos matriks	11
2.3.3 Invers matriks.....	11
2.3.4 Operasi matriks	11
2.3.5 Jenis matriks.....	12
2.4 Analisis Multivariat	13
2.4.1 Matriks data multivariat	13
2.4.2 Vektor <i>mean</i> dan matriks <i>variance-covariance</i>	13
2.5 Turunan Parsial	14
2.6 Fungsi <i>Lagrange</i>	14
2.7 Jarak <i>Euclidean</i>	15
2.8 Standardisasi Data	16
2.9 Analisis Kluster	16
2.9.1 Analisis kluster K-Means	17
2.10 Investasi	18
2.10.1 Proses investasi	19
2.10.2 <i>Return</i> dan risiko investasi	20
2.11 Rasio Keuangan	21
2.11.1 <i>Return on Asset</i> (ROA).....	21
2.11.2 <i>Return on Equity</i> (ROE).....	21

2.11.3	<i>Debt to Equity Ratio (DER)</i>	22
2.11.4	<i>Net Profit Margin (NPM)</i>	22
2.12	Saham	22
2.12.1	<i>Return saham</i>	23
2.13	Diversifikasi	23
2.14	LQ45	24
2.15	<i>Short Selling</i>	25
 BAB III PENENTUAN BOBOT PORTOFOLIO DENGAN STRATEGI <i>MAXIMUM DIVERSIFICATION</i> BERDASARKAN ALGORITMA K- MEANS++		
3.1	Algoritma K-Means++	26
3.2	Pemilihan Jumlah Kluster Optimal	28
3.3	Portofolio	29
3.4	Portofolio <i>Maximum Diversification</i>	32
3.4.1	Rasio diversifikasi	32
3.4.2	Pembobotan portofolio <i>maximum diversification</i>	35
3.5	Portofolio dengan Strategi <i>Maximum Diversification</i> Berdasarkan Algoritma K-Means++	41
3.6	Pengukuran Kinerja Portofolio	42
 BAB IV STUDI KASUS		
4.1	Deskripsi Data	44
4.2	<i>Return Saham</i>	46
4.3	Portofolio <i>Maximum Diversification</i>	46
4.4	Portofolio dengan Strategi <i>Maximum Diversification</i> Berdasarkan Algoritma K-Means++	47
4.5	Perbandingan Kinerja Portofolio	51
 BAB V PENUTUP		
5.1	Kesimpulan	53
5.2	Saran	54
DAFTAR PUSTAKA		55
LAMPIRAN		58