

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI.....	xii
<i>ABSTRACT</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Batasan Masalah.....	2
1.3. Tujuan Penelitian.....	3
1.4. Metode Penelitian.....	3
1.5. Tinjauan Penelitian.....	5
1.6. Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1. Variabel <i>Random</i>	7
2.2. Harga Harapan (<i>Expected Value</i>) Dari Variabel <i>Random</i>	8
2.3. Variansi dan Kovariansi Dari Variabel <i>Random</i>	9
2.4. Dasar-dasar Aljabar Matriks	10
2.4.1. Transpos Matriks	11

2.4.2. Invers Matriks	11
2.4.3. Jenis-jenis Matriks	12
2.4.4. Operasi Matriks.....	15
2.5. Vektor.....	16
2.6. Distribusi Normal	17
2.7. Uji Normalitas <i>Kolmogorov-Smirnov</i>	18
2.8. Analisis Multivariat.....	19
2.9. Metode Pengali <i>Lagrange</i>	21
2.10. Investasi.....	22
2.10.1. Jenis-jenis Investasi	22
2.10.2. Proses Investasi	24
2.10.3. Risiko Investasi	26
2.11. Saham	26
2.11.1. <i>Return</i> Saham.....	27
2.12. <i>Short-selling</i>	28
2.13. Portofolio Markowitz	28
2.13.1. Portofolio Efisien dan Portofolio Optimal.....	29
2.14. IDX30.....	29
2.15. Simulasi <i>Monte Carlo</i>	30
BAB III OPTIMASI PORTOFOLIO MULTI OBJEKTIF MENGGUNAKAN	
METODE <i>RESAMPLED EFFICIENT FRONTIER</i>.....	32
3.1. <i>Stock Filtering</i>	32
3.2. Portofolio Multi Objektif	32
3.3. Pembentukan Portofolio Berdasarkan Metode <i>Resampled Efficient</i>	
<i>Frontier</i>	37

3.4. <i>Value at Risk</i>	39
BAB IV STUDI KASUS	40
4.1. Objek Penelitian	40
4.2. Plot Pergerakan Harga Saham	42
4.3. <i>Return</i> Saham	42
4.4. Uji Normalitas <i>Return</i> Saham	42
4.5. <i>Stock Filtering</i>	44
4.6. Pembobotan Portofolio Multi Objektif Menggunakan Metode <i>Resampled Efficient Frontier</i>	45
4.7. Kinerja Portofolio di Pasar	48
BAB V PENUTUP.....	50
5.1. Kesimpulan.....	50
5.2. Saran.....	51
DAFTAR PUSTAKA	52
LAMPIRAN	54