

DAFTAR ISI

SKRIPSI.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI.....	xiii
<i>ABSTRACT</i>	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Permasalahan	1
1.2 Batasan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Tinjauan Pustaka	4
1.5 Metode Penelitian.....	7
1.6 Sistematika Penulisan.....	7
BAB II DASAR TEORI	9
2.1 Variabel Random.....	9
2.2 Harga Harapan Variabel Random	10
2.3 Variansi dan Kovariansi Variabel Random.....	11
2.4 Matriks.....	15
2.4.1 Definisi Matriks	15
2.4.2 Jenis Matriks	16
2.4.3 Operasi Matriks	18
2.5 Vektor.....	20

2.6	Distribusi Normal	21
2.7	Uji Normalitas <i>Kolmogorov-Smirnov</i>	23
2.8	Analisis Multivariat	25
2.8.1	Matriks Data Multivariat	25
2.8.2	Vektor mean dan matriks <i>variance-covariance</i>	25
2.8.3	Kombinasi linear variabel random untuk vektor <i>mean</i> dan matriks <i>variance-covariance</i>	26
2.9	<i>Lagrange Multipliers</i>	27
2.10	Turunan Parsial	28
2.11	Investasi	28
2.12	Saham	30
2.13	<i>Return</i> Saham	30
2.14	Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI)	32
2.15	<i>Short Selling</i>	33
2.16	Portofolio	33
2.17	Portofolio Markowitz	34
2.17.1	Portofolio efisien dan portofolio optimal	35
2.17.2	Pembobotan portofolio <i>mean variance</i>	36
BAB III OPTIMISASI PORTOFOLIO MENGGUNAKAN ALGORITMA		
<i>PARTICLE SWARM OPTIMIZATION</i>		41
3.1	<i>Particle Swarm Optimization</i> (PSO)	41
3.1.1	Fungsi <i>Fitness</i>	42
3.1.2	Pergerakan Partikel	44
3.1.3	Parameter Algoritma <i>Particle Swarm Optimization</i>	47
3.1.4	Masalah Optimisasi Portofolio Dibatasi	49
3.1.5	Algoritma <i>Particle Swarm Optimization</i>	51
3.2	Optimisasi Portofolio Menggunakan Algoritma <i>Particle Swarm Optimization</i> Berdasarkan Eliminasi Saham	52
3.3	Penilaian Kinerja Portofolio Optimal	56
BAB IV STUDI KASUS		57
4.1	Data	57
4.2	<i>Return</i> Saham	58

4.3	Uji Normalitas <i>Return</i> Saham	59
4.4	Pembobotan Portofolio <i>Mean Variance</i>	60
4.5	Pembobotan Portofolio Menggunakan <i>Particle Swarm Optimization</i> ...	61
4.6	Penilaian Kinerja Portofolio	64
4.7	Kinerja Portofolio di Pasar	65
BAB V PENUTUP.....		68
5.1	Kesimpulan.....	68
5.2	Saran	69
DAFTAR PUSTAKA		70
LAMPIRAN.....		73