

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMBANG	xii
DAFTAR LAMBANG	xiii
INTISARI	xiv
ABSTRACT	xv
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Tujuan dan Manfaat Penelitian	2
1.3. Rumusan Masalah	3
1.4. Tinjauan Pustaka	3
1.5. Metodologi Penelitian	4
1.6. Sistematika Penulisan	5
II DASAR TEORI	6
2.1. Portofolio	6
2.1.1. Investasi	6
2.1.2. Pasar Modal	7
2.1.3. Indeks LQ45	8
2.1.4. Portofolio Saham	8
2.2. Himpunan <i>Fuzzy</i>	10
2.2.1. Pengenalan Himpunan <i>Fuzzy</i>	10
2.2.2. α -Cuts	13
2.2.3. Himpunan <i>Fuzzy</i> Konveks	13
2.2.4. Operasi Aritmatika pada Bilangan <i>Fuzzy</i>	16
2.2.5. <i>Triangular Fuzzy Number</i> (TFN)	17
2.3. Optimisasi Portofolio	20

2.3.1. Model <i>Mean-Variance</i>	21
2.4. Program Kuadratis	26
2.4.1. Bentuk Kuadratis	26
2.4.2. Permasalahan Program Kuadratis	26
2.4.3. Kondisi Kuhn-Tucker	27
2.4.4. Fungsi Lagrange	29
III OPTIMISASI PORTOFOLIO RATA-RATA VARIANSI (<i>MEAN VARI- ANCE</i>) FUZZY DENGAN PROGRAM KUADRATIS	30
3.1. Formulasi Permasalahan	30
3.1.1. Notasi	31
3.1.2. Fungsi Objektif	32
3.1.3. Kendala	32
3.1.4. Pembentukan Model	33
3.2. Penyelesaian Optimisasi Portofolio Rata-Rata Variansi <i>Fuzzy</i>	36
3.3. Simulasi Numerik	41
3.3.1. Permasalahan	41
3.3.2. Penyelesaian Permasalahan	42
3.3.3. Interpretasi	58
IV IMPLEMENTASI OPTIMISASI PORTOFOLIO RATA-RATA VARI- ANSI FUZZY PADA SAHAM INDEKS LQ45	59
4.1. Pemilihan Saham	59
4.2. Permasalahan	62
4.3. Pembuatan Model Optimisasi Berdasarkan Permasalahan	62
4.4. Penyelesaian Model Optimisasi	70
4.5. Hasil	84
V PENUTUP	87
5.1. Kesimpulan	87
5.2. Saran	88
DAFTAR PUSTAKA	89
A KODE PROGRAM LINGO 16.0 ILUSTRASI NUMERIK MASALAH PORTOFOLIO INVESTASI BAB IV	90