

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN MOTO DAN PERSEMBAHAN	iv
PRAKATA.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI.....	xiii
ABSTRACT.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	15
1.1 Latar Belakang.....	15
1.2 Batasan Masalah	16
1.3 Tujuan Penelitian	17
1.4 Tinjauan Pustaka.....	17
1.5 Metodologi Penelitian.....	18
1.6 Sistematika Penulisan	19
BAB II LANDASAN TEORI	20
2.1 Variabel Random	20
2.2 Ekspektasi, Variansi, dan Kovariansi dari Variabel Random.....	23
2.3 Vektor dan Matriks	26
2.4 Fungsi Derivatif.....	31
2.5 Turunan Parsial	35
2.6 <i>Lagrange Multipliers</i>	37
2.7 Investasi	38
2.8 Saham.....	39
2.8.1 Indeks Saham.....	43
2.8.2 <i>Return</i> Harga Saham.....	45
2.9 Portfolio	47

BAB III PERBANDINGAN PENGGUNAAN <i>CLASSIC ALGORITHM</i> , <i>GENETIC ALGORITHM</i> , DAN <i>PSO ALGORITHM</i> UNTUK MEMBENTUK PORTFOLIO OPTIMAL DENGAN KRITERIA PEMBAGIAN DIVIDEN DAN MODEL MULTI OBJEKTIF SR-ES-TR	48
3.1 <i>Classic Algorithm</i>	48
3.2 <i>Genetic Algorithm</i>	50
3.2.1 Istilah dalam <i>Genetic Algorithm</i>	51
3.2.2 Operator <i>Genetic Algorithm</i>	53
3.2.3 Struktur Umum <i>Genetic Algorithm</i>	57
3.2.4 <i>Genetic Algorithm</i> dalam Optimisasi Portfolio	58
3.3 <i>PSO Algorithm</i>	60
3.3.1 Istilah dalam <i>PSO Algorithm</i>	61
3.3.2 Pergerakan Partikel	61
3.3.3 Struktur Umum <i>PSO Algorithm</i>	63
3.3.4 <i>PSO Algorithm</i> dalam Optimisasi Portfolio	64
3.4 Portfolio Optimal dan <i>Efficient Frontier</i>	66
3.4.1 Optimisasi <i>Multi-Objective</i>	66
3.4.2 Model SR-ES-TR	68
BAB IV STUDI KASUS	72
4.1. Deskripsi Data	73
4.2. <i>Portfolio Optimization</i> Menggunakan <i>Classic Algorithm</i>	75
4.3. <i>Portfolio Optimization</i> Menggunakan <i>Genetic Algorithm</i>	80
4.4. <i>Portfolio Optimization</i> Menggunakan <i>PSO Algorithm</i>	86
4.5. Perbandingan Portfolio Optimal dari <i>Classic Algorithm</i> , <i>Genetic Algorithm</i> , dan <i>PSO Algorithm</i>	92
4.6. Kinerja Portfolio di Pasar Saham	94
BAB V PENUTUP	96
5.1 Kesimpulan	96
5.2 Saran	97
DAFTAR PUSTAKA	98
LAMPIRAN	102