



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	2
1.3 Tujuan Penelitian.....	3
1.4 Tinjauan Pustaka.....	3
1.5 Metode Penelitian.....	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	6
2.1 Variabel Random.....	6
2.1.1 Nilai harapan.....	7
2.1.2 Variansi dan kovariansi.....	8
2.1.3 Distribusi normal.....	8
2.2 Ukuran Statistik.....	9
2.2.1 Ukuran pemusatan.....	9
2.2.2 Ukuran keragaman.....	10
2.3 Matriks.....	10
2.3.1 Definisi matriks.....	10
2.3.2 Jenis-jenis matriks.....	11
2.3.3 Operasi matriks.....	12
2.3.4 <i>Transpose</i> matriks.....	13
2.3.5 <i>Invers</i> matriks.....	14
2.4 Analisa Multivariabel.....	15
2.4.1 Matriks data multivariabel.....	15
2.4.2 <i>Mean</i> dan varian-kovarian.....	15
2.4.3 Kombinasi linear untuk matriks <i>mean</i> dan kovarian...	16
2.5 Turunan Parsial.....	17
2.6 Metode Pengali Lagrange.....	18
2.7 Investasi.....	18
2.7.1 Definisi investasi.....	18
2.7.2 Jenis investasi.....	19
2.7.3 Proses investasi.....	20
2.8 Pasar Modal dan Saham.....	22
2.9 Teori Portofolio.....	26



BAB III OPTIMISASI PORTOFOLIO DENGAN METODE <i>MEDIAN</i> <i>VARIANCE</i> PADA DATA TERBATAS.....	28
3.1 Optimisasi Portofolio dengan Metode <i>Mean Variance</i>	28
3.2 Optimisasi Portofolio dengan Metode <i>Median Variance</i> pada Data Terbatas.....	31
BAB IV STUDI KASUS.....	34
4.1 Deskripsi Data.....	34
4.2 Perangkat Lunak yang Digunakan.....	35
4.2.1 <i>Software</i> Microsoft Office Excel 2016.....	35
4.2.2 <i>Software</i> R 3.4.3.....	35
4.3 Karakteristik <i>Return</i> Saham.....	36
4.4 Optimisasi Portofolio dengan Metode <i>Median Variance</i> pada Data Terbatas.....	37
4.5 Investasi pada Portofolio Optimal dengan Metode <i>Median</i> <i>Variance</i> pada Data Terbatas.....	38
BAB V PENUTUP.....	40
5.1 Kesimpulan.....	40
5.2 Saran.....	41
DAFTAR PUSTAKA.....	42
LAMPIRAN.....	44