

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN</b>	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b>	<b>iv</b>
<b>HALAMAN MOTTO</b>	<b>v</b>
<b>PRAKATA</b>	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMBANG</b>	<b>xii</b>
<b>INTISARI</b>	<b>xiii</b>
<b>ABSTRACT</b>	<b>xiv</b>
<b>I PENDAHULUAN</b>	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	2
1.3. Tujuan Penelitian	2
1.4. Manfaat Penelitian	3
1.5. Batasan Penelitian	3
1.6. Tinjauan Pustaka	4
1.7. Metodologi Penelitian	4
1.8. Sistematika Penulisan	5
<b>II DASAR TEORI</b>	<b>7</b>
2.1. Portofolio	7
2.1.1. Saham di Indonesia	9
2.1.2. Keuntungan Investasi Saham di Indonesia	9
2.1.3. Risiko Investasi Saham di Indonesia	10
2.1.4. Indeks Harga Saham	11
2.2. Program Linear	12
2.2.1. Algoritma Simpleks	14
2.3. Program Non-Linear	18
2.3.1. Teori Kuhn Tucker	20
2.4. Metode <i>Branch and Bound</i>	23
2.5. Optimisasi Portofolio	24
2.5.1. Model Rata-rata Variansi	27

2.6.	Teori Fuzzy . . . . .	33
2.6.1.	Himpunan Fuzzy . . . . .	33
2.7.	Fungsi Terukur . . . . .	36
2.8.	Teori Kredibilitas . . . . .	38
<b>III</b>	<b>KREDIBILITAS VARIABEL FUZZY . . . . .</b>	<b>45</b>
3.1.	Fuzzy Kredibilitas . . . . .	45
3.1.1.	Kredibilitas Variabel Fuzzy . . . . .	48
<b>IV</b>	<b>APLIKASI PENDEKATAN FUZZY PADA MODEL OPTIMISASI PORTOFOLIO RATA-RATA VARIANSI MENGGUNAKAN TEORI KREDIBILITAS . . . . .</b>	<b>53</b>
4.1.	Seleksi Portofolio Berdasarkan Teori Kredibilitas . . . . .	54
4.1.1.	Notasi . . . . .	54
4.1.2.	Fungsi Objektif . . . . .	54
4.1.3.	Kendala . . . . .	55
4.1.4.	Keputusan Permasalahan . . . . .	57
4.2.	Metodologi Solusi . . . . .	57
4.2.1.	Tahap Pertama : Model Program Nonlinear <i>Mixed Integer</i> Multi Objektif dengan Menggunakan Data Historis . . . . .	57
4.2.2.	Tahap Kedua : Pendekatan Fuzzy Interaktif . . . . .	59
4.3.	Ilustrasi Numerik . . . . .	65
<b>V</b>	<b>IMPLEMENTASI DAN UJI COBA . . . . .</b>	<b>72</b>
5.1.	Sarana Implementasi . . . . .	72
5.1.1.	Perangkat keras ( <i>hardware</i> ) . . . . .	72
5.1.2.	Perangkat lunak ( <i>software</i> ) . . . . .	72
5.2.	Laporan Implementasi . . . . .	73
5.2.1.	Hasil Implementasi . . . . .	77
5.2.2.	Analisis Sensitivitas . . . . .	78
<b>VI</b>	<b>PENUTUP . . . . .</b>	<b>79</b>
6.1.	Kesimpulan . . . . .	79
6.2.	Saran . . . . .	79
	<b>DAFTAR PUSTAKA . . . . .</b>	<b>81</b>
<b>A</b>	<b>PROGRAM LINGO 16.0 CONTOH MASALAH MILP MENGGUNAKAN METODE <i>BRANCH AND BOUND</i> . . . . .</b>	<b>83</b>
<b>B</b>	<b>PROGRAM LINGO 16.0 ILUSTRASI NUMERIK SEDERHANA MASALAH PORTOFOLIO INVESTASI BAB IV . . . . .</b>	<b>85</b>
<b>C</b>	<b>PROGRAM LINGO 16.0 MASALAH PORTOFOLIO INVESTASI SAHAM LQ45 BEI . . . . .</b>	<b>90</b>