

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
PRAKARTA.....	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Tinjauan Pustaka	5
1.6 Metode Penelitian	6
1.7 Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Variabel Random	8
2.2 Matriks	11
2.3 Analisis Multivariabel	17
2.4 Metode Optimisasi Nonlinier.....	21
2.5 Investasi dan Teori Portofolio	28
2.6 Fungsi Kuantil.....	37
2.7 <i>Value at Risk</i> (VaR)	38
2.8 Konsep Koheren	39
2.9 Ukuran Deviasi	42

BAB III STANDARD DEVIATION, VAR, DAN ELD DAN APLIKASINYA TERHADAP OPTIMISASI PORTOFOLIO

3.1 Pemilihan Ukuran Risiko.....	46
3.2 Aplikasi ELD pada Portofolio.....	56
3.3 <i>Backtesting</i>	57

BAB IV STUDI KASUS

4.1 Pemilihan Data Saham	59
4.2 Mencari Bobot Optimal Portofolio.....	61
4.3 Menentukan Standar deviasi, VaR, dan ELD	64
4.4 <i>Backtesting</i>	66

BAB V PENUTUP

5.1 Kesimpulan	69
5.2 Saran.....	69

DAFTAR PUSTAKA.....	71
----------------------------	-----------

LAMPIRAN.....	73
----------------------	-----------