



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTI SARI	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Pembatasan Masalah	2
1.3. Tujuan Penulisan	3
1.4 Tinjauan Pustaka	3
1.5 Metode Penelitian	5
1.6 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1 Asumsi Distribusi Normal	7
2.1.1 Distribusi Normal	7
2.1.2 Uji Normalitas Jarque-Berra	7
2.2 Ukuran Numerik	8
2.2.1 Data	8
2.2.2 Aset	9
2.3 Optimasi Lagrange	10
2.4 Dasar-Dasar Aljabar Matriks	10
2.4.1 Definisi Matriks	10
2.4.2 Invers Matriks	11
2.4.3 Matriks Identitas	11
2.4.4 Kalkulus Matriks	11
2.5 Iterasi Newton-Raphson	12
2.6 Investasi	14
2.6.1 Definisi investasi	14
2.6.2 Investor	14
2.6.3 Perlunya investasi	14
2.6.4 Jenis-jenis investasi	15
2.6.5 Proses investasi	15
2.6.6 Pembentukan portofolio	17
2.6.7 Tingkat pengembalian (return)	18
2.6.8 Risiko portofolio	20
2.7 Pasar Modal	21
2.7.1 Pengertian pasar modal	21



2.7.2 Instrumen pasar modal.....	21
2.7.3 Pengertian indeks saham	21
2.7.4 Keunggulan indeks saham	22
BAB III PENENTUAN BOBOT PORTOFOLIO BERDASARKAN <i>MEAN-VARIANCE</i> DAN <i>MENTAL ACCOUNTS</i>	23
3.1 Perhitungan <i>Return</i> Saham	23
3.2 Karakteristik Saham	24
3.3 Karakteristik Portofolio Saham	25
3.1. Penentuan Bobot Portofolio berdasarkan <i>Mean-Variance</i> dan <i>Mental Account</i>	27
3.3.1 Optimasi <i>mean-variance</i>	27
3.3.2 Permasalahan <i>mental accounts</i>	28
3.3.3 Penyelesaian persamaan dengan iterasi Newton-Raphson	31
BAB IV STUDI KASUS	35
4.1 Deskripsi Data	35
4.2 Perangkat Lunak yang Digunakan	37
4.2.1 <i>Software</i> Microsoft Office Excel 2007	37
4.2.2 <i>Software</i> R 3.4.0	37
4.3 Permasalahan	37
4.4 Karakteristik Data	38
4.4.1 Karakteristik <i>return</i> saham	38
4.4.2 Normalitas data masing-masing saham	39
4.5 Komposisi Bobot Portofolio Berdasarkan <i>Mean-Variance</i> dan <i>Mental Accounts</i>	41
4.5.1 Bobot portofolio berdasarkan <i>mean-variance</i> dan <i>mental accounts</i>	41
4.5.2 Nilai <i>Value at Risk</i> dan <i>Treshold Error</i> portofolio optimal	43
BAB V PENUTUP	44
5.1 Kesimpulan	44
5.2 Saran	46
DAFTAR PUSTAKA	47
LAMPIRAN	49