

DAFTAR ISI

JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Batasan Masalah.....	3
1.3 Tujuan Penelitian	3
1.4 Tinjauan Pustaka	3
1.5 Metodologi Penelitian	5
1.6 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Variabel Random	7
2.2 Harga Harapan, Variansi dan Kovariansi.....	7
2.3 Matriks	8
2.4 Distribusi Normal.....	11
2.5 Analisis Multivariate.....	11
2.6 Turunan Parsial	12

2.7	Lagrange Multiplier	13
2.8	Jarak Euclidean	14
2.9	Investasi.....	14
2.10	Saham.....	15
2.11	Pembentukan Portofolio Optimal.....	17
2.12	Indeks LQ-45	17
2.13	<i>Short Selling</i>	18
2.14	Analisis Cluster	18
2.14.1	<i>K-Means Clustering</i>	18
2.14.2	Algoritma <i>K-Means Clustering</i>	19
BAB III OPTIMISASI PORTOFOLIO MULTI OBJEKTIF MENGGUNAKAN ANALISIS FUZZY C-MEANS CLUSTERING		
3.1	Menghitung Tingkat Pengembalian dan Tingkat Risiko	21
3.2	Pengelompokan Saham Menggunakan <i>Fuzzy C-Means (FCM)</i>	21
3.2.1	Parameter <i>fuzzy c-means</i>	23
3.2.2	Validitas kluster.....	26
3.2.3	Algoritma <i>fuzzy c-means</i>	27
3.3	Multi-Objective Portfolio Optimization.....	28
3.4	Algoritma Optimisasi Portofolio Multi-Objective Menggunakan Analisis Kluster <i>Fuzzy C-Means</i>	33
BAB IV STUDI KASUS		
4.1	Objek Penelitian	35
4.2	Metode Penelitian.....	36
4.3	Plot Pergerakan Harga Saham.....	36
4.4	Menghitung Tingkat Pengembalian dan Tingkat Risiko	40

4.5	Pengelompokan Saham Menggunakan <i>Fuzzy C-Means (FCM)</i>	41
4.5.1	Validitas kluster.....	42
4.5.2	<i>Fuzzy c-means clustering</i>	43
4.6	Uji Normalitas Saham	44
4.7	Multi-Objektif Porfolio Optimization	45
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Kesimpulan	47
5.2	Saran.....	48
DAFTAR PUSTAKA		49
LAMPIRAN		51