

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN	ii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iii
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I	1
1.1 Latar Belakang dan Permasalahan	1
1.2 Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.3 Batasan Masalah	3
1.4 Tinjauan Pustaka.....	3
1.5 Metode Penulisan.....	4
1.6 Sistematika Penulisan	4
BAB II	6
2.1 Variabel Random	6
2.1.1 Variabel Random Diskrit.....	6
2.1.2 Variabel Random Kontinu.....	7
2.2 Variansi dan Kovariansi.....	7
2.3 Matriks	11
2.3.1 Pengertian Matriks	11
2.3.2 Jenis-jenis Matriks.....	12
2.3.3 Penjumlahan dan Pengurangan Matriks	15
2.3.4 Perkalian Matriks	15
2.3.5 Transpose Matriks	15
2.3.6 Inverse Matriks.....	16
2.4 Vektor	17

2.5	Analisis Multivariat	18
2.5.1	Matriks data multivariat	19
2.5.2	Vektor <i>mean</i> dan matriks <i>variance-covariance</i>	19
2.5.3	Kombinasi linear variabel random untuk vektor <i>mean</i> dan matriks <i>variance-kovariance</i>	21
2.6	<i>Lagrange Multipliers</i>	22
2.7	Turunan Parsial	23
2.8	Saham.....	24
2.8.1	Indeks LQ-45.....	25
2.8.2	<i>Return</i> Saham	26
2.9	Ivestasi	27
2.9.1	Proses Investasi Saham	28
2.9.2	Diversifikasi Investasi.....	29
2.9.3	Risiko Investasi	30
2.10	Distribusi Normal.....	31
2.11	Uji Normalitas Jarque Bera.....	32
BAB III	34
3.1	Standardisasi Dana.....	34
3.2	Algoritma Genetika.....	36
3.3	Optimisasi Portofolio Menggunakan Algoritma Genetika	37
3.3.1	Representasi	38
3.3.2	Inisialisasi	38
3.3.3	Perhitungan Kecocokan	38
3.3.4	Seleksi.....	39
3.3.5	Persilangan (<i>crossover</i>).....	39
3.3.6	Mutasi	40
3.4	Portofolio <i>Mean Variance</i>	41
3.5	Penilaian Portofolio Optimal	43
BAB IV	45
4.1.	Deskripsi Data.....	45
4.2.	Metode Penelitian	46
4.3.	Plot Pergerakan Harga Saham.....	46
4.4.	Standardisasi Dana.....	49
4.5.	<i>Return</i> (Tingkat Pengembalian) Saham	49



4.6.	Uji Normalitas <i>Return</i> Saham.....	50
4.7.	Pembobotan Portofolio <i>Mean Variance</i>	51
4.8.	Pembobotan Portofolio Menggunakan Algoritma Genetika berdasarkan Standardisasi Dana.....	52
4.9.	Penilaian Kerja Portofolio.....	52
BAB V	54
5.1	Kesimpulan	54
5.2	Saran	54
DAFTAR PUSTAKA	55
LAMPIRAN	57

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Representasi.....	38
Tabel 4.1 Deskripsi Data.....	46
Tabel 4.2 Daftar 5 Saham yang Digunakan.....	46
Tabel 4.3 Nilai Statistik <i>Jarque Bera</i> masing-masing Saham.....	51
Tabel 4.4 Bobot Portofolio <i>Mean Variance</i>	52
Tabel 4.5 Bobot Portofolio Menggunakan Algoritma Genetika berdasarkan Standardisasi Dana.....	53
Tabel 4.6 <i>Sharpe Ratio</i>	54

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.1. Struktur Algoritma Genetika.....	37
Gambar 3.2 Persilangan	40
Gambar 3.3 Mutasi.....	41
Gambar 4.1 Plot Pergerakan Harga Saham BSDE.....	46
Gambar 4.2 Plot Pergerakan Harga Saham INDF	47
Gambar 4.3 Plot Pergerakan Harga Saham KLBF.....	48
Gambar 4.4 Plot Pergerakan Harga Saham PTBA.....	48
Gambar 4.5 Plot Pergerakan Harga Saham TLKM	48

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1. Data Harga Saham	57
LAMPIRAN 2. Data Return Saham	58
LAMPIRAN 3. Data Return Standardisasi Dana.....	60
LAMPIRAN 4. Script Program Menggunakan Software R	61
LAMPIRAN 5. Hasil Standardisasi Dana	68
LAMPIRAN 6. Hasil Portofolio Mean Variance.....	70
LAMPIRAN 7. Hasil Portofolio Menggunakan Algoritma Genetika berdasarkan Standardisasi Dana.....	70