

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN MOTTO	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
INTISARI.....	xiv
<i>ABSTRACT</i>	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Pembatasan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penulisan	4
1.4 Tinjauan Pustaka	5
1.5 Metode Penulisan	6
1.6 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Nilai Ekspektasi.....	8
2.2 Variansi dan Kovariansi	8
2.3 Matriks.....	9
2.3.1 Operasi Matriks	9
2.3.2 Invers Matriks	11

2.4	Nilai Eigen dan Vektor Eigen.....	12
2.5	Matriks Data Multivariat	12
2.6	Turunan Parsial.....	14
2.7	Turunan Parsial Derajat Dua	15
2.8	Metode Lagrange	15
2.8.1	Satu Kali Pengali Lagrange.....	15
2.8.2	Lebih Dari Satu Pengali Lagrange	16
2.9	Jarak Euclidean.....	16
2.10	Pasar Modal	17
2.11	Saham	18
2.12	Proses Investasi	20
2.13	Risiko dalam Investasi.....	21
2.14	Return	22
BAB III OPTIMISASI PORTOFOLIO MEAN-SEMIVARIANCE BERDASARKAN ANALISIS KLASTER K-MEANS		24
3.1	Analisis Kluster	24
3.1.1.	Analisis Kluster K-Means.....	25
3.1.2.	Pemilihan Jumlah Kluster K yang Tepat	27
3.2	Portofolio.....	29
3.2.1	Portofolio <i>Mean-Semivariance</i>	30
3.3	Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> Menggunakan Analisis Kluster K-Means	34
3.4	Pengukuran Kinerja Portofolio.....	36
BAB IV STUDI KASUS		38
4.1	Deskripsi Data	38
4.2	Metode Penelitian	39
4.3	Return Saham	39

4.4	Pembobotan Portofolio <i>Mean-Semivariance</i>	39
4.5	Analisis Klaster K-Means.....	40
4.6	Pembobotan Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> Berdasarkan Analisis Klaster K-Means.....	42
4.7	Penilaian Kinerja Portofolio	43
4.8	Perbandingan Optimisasi Portofolio.....	44
BAB V PENUTUP.....		45
5.1	Kesimpulan	45
5.2	Saran.....	46
DAFTAR PUSTAKA		47
LAMPIRAN		49