



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN MOTTO/PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Tujuan Penelitian	4
1.3. Manfaat Penelitian	4
1.4. Pembatasan Masalah	5
1.5. Tinjauan Pustaka	5
1.6. Metode Penelitian	6
1.7. Sistem Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1. Variabel Random	8
2.2. Distribusi Normal	9
2.3. Harga Harapan	9
2.4. Kovariansi dan Korelasi	11
2.5. Matriks	12
2.6. Investasi	15
2.7. Pasar Modal	17
2.8. Aset Berisiko	20
2.9. Saham	20
2.9.1. <i>Return</i> Saham	21
2.10. Teori Portofolio	23
2.10.1. Pembentukan Portofolio <i>Mean-Variance</i>	24
2.10.2. <i>Return</i> Harapan (<i>Expected return</i>) Portofolio	30
2.10.3. Nilai Risiko Portofolio	31
BAB III ALGORITMA GENETIKA UNTUK MENGOPTIMALISASI PORTOFOLIO	
3.1. Portfolio theory, Index Fund, dan Index Tracking	32
3.2. Algoritma Genetika	33
3.2.1. Struktur Umum	36
3.2.2. Pengkodean Kromosom	37
3.2.3. Seleksi	39
3.2.4. Perkawinan Silang	44
3.2.5. Mutasi	49
3.2.6. <i>Elitism</i>	51



3.3.	Variabel yang Berelasi	52
3.3.1.	Portofolio beta.....	52
3.3.2.	Jumlah perdagangan dan kapitalisasi pasar	53
3.4.	Skema Portofolio.....	53
BAB IV STUDI KASUS		
4.1.	Deskripsi Data	62
4.2.	Variasi nilai v_1 , v_2 dan v_3	64
4.3.	Variasi nilai l dan T_s	73
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1.	Kesimpulan	82
5.2.	Saran	83
DAFTAR PUSTAKA		84
LAMPIRAN		86