

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	Error! Bookmark not defined.
PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	Error! Bookmark not defined.
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Tujuan Penulisan.....	4
1.3 Batasan Masalah.....	5
1.4 Tinjauan Pustaka.....	5
1.5 Metode Penulisan.....	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	7
BAB II DASAR TEORI.....	9
2.1 Variabel Random.....	9
2.1.1 Definisi Variabel Random.....	9
2.1.2 Variabel Random Diskrit.....	9
2.1.3 Variabel Random Kontinu.....	9
2.2 Nilai Ekspektasi.....	10
2.3 Variansi dan Kovariansi.....	10
2.4 Matriks.....	11
2.4.1 Transpose Matriks dan Matriks Identitas.....	12
2.4.2 Invers Matriks.....	12
2.4.3 Matriks Data Multivariat.....	13
2.5 Metode Lagrange.....	14
2.5.1 Satu Pengali Lagrange.....	14
2.5.2 Lebih dari Satu Pengali Lagrange.....	15
2.6 Turunan Parsial.....	15
2.6.1 Turunan Parsial Derajat 2.....	16
2.7 Matriks Hessian.....	16
2.8 Downside Risk.....	17
2.9 Semivariansi.....	17
2.10 Matriks Semivariansi dan Kosemivariansi.....	18
2.11 Kondisi <i>Karush-Kuhn-Tucker</i> (KKT).....	19
2.12 Fungsi Konveks dan Konkaf.....	20
2.13 Metode Newton.....	21
2.14 Bentuk Primal dan Bentuk Dual.....	22
2.15 Quadratic Programming.....	23

2.16 Fungsi Barrier.....	25
2.17 Penyelesaian Masalah <i>Quadratic Programming</i> dengan Metode Titik Interior Primal-Dual	26
2.18 Teori Portofolio	30
2.19 Return	31
2.20 Proses Investasi	32
2.21 Risiko dalam Investasi.....	33
BAB III MODEL PORTOFOLIO LOWER PARTIAL MOMENT DERAJAT 2 MENGGUNAKAN METODE QUADRATIC PROGRAMMING.....	35
3.1 <i>Return, Expected Return, Variansi</i> Portofolio.....	36
3.2 Portofolio Mean-Lower Partial Moment.....	36
3.2.1 Model Portofolio <i>Mean-Lower Partial Moment</i>	37
3.2.2 Pembobotan Portofolio <i>Lower Partial Moment (LPM)</i> Derajat 2	38
3.2.3 Algoritma penyelesaian Masalah <i>Quadratic Programming</i> Portofolio <i>Mean-LPM</i> derajat 2 dengan Metode Titik Interior	44
3.2.4 Flow Chart Pembentukan Model Portofolio <i>Lower Partial Moment (LPM)</i> Derajat 2 dengan Kuadrat Program	46
3.3 Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> dengan Pendekatan Heuristik.....	48
3.3.1 Model Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> dengan Pendekatan Heuristik	49
3.3.2 Ukuran Risiko Portofolio <i>Mean-Semivariance</i>	50
3.3.3 Pendekatan Heuristik	51
3.3.4 Pembobotan Metode <i>Mean-Semivariance</i>	52
3.4 Pengukuran Kinerja Portofolio.....	54
BAB IV STUDI KASUS	56
4.1 Deskripsi Data.....	56
4.2 Return Saham.....	58
4.3 Portofolio Mean-LPM Derajat 2.....	58
4.3.1 Pembobotan Portofolio <i>Mean-LPM</i> Derajat 2	61
4.4 Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> dengan Pendekatan Heuristik	63
4.5 Perbandingan Kinerja Portofolio	64
4.6 Evaluasi Kinerja Portofolio.....	65
BAB V PENUTUP.....	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Saran	67
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN	70