

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL	x
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	2
1.3 Tujuan	2
1.4 Metodologi Penyelesaian Masalah	2
1.5 Sistematika Penulisan	3
BAB 2 KAJIAN PUSTAKA	5
2.1 Saham	5
2.1.1 Indeks Harga Saham LQ45	5
2.2 <i>Return</i> , Ekspektasi <i>Return</i> dan Risiko Saham	6
2.2.1 <i>Return</i>	6
2.2.2 Ekspektasi <i>Return</i>	7
2.2.3 Risiko	7
2.2.4 Distribusi Normal Multivariat	8
2.3 Portofolio Saham	8
2.3.1 Ekspektasi <i>Return</i> Portofolio	9
2.3.2 Risiko Portofolio	9
2.4 Seleksi Portofolio <i>Mean-Variance</i>	10
2.5 <i>The Conservative Short Sale Model</i>	12
2.6 <i>Short Selling</i>	16
2.7 <i>Quadratic Programming</i>	16
BAB 3 PERANCANGAN SISTEM	18

3.1 Deskripsi Sistem.....	18
3.2 Perancangan Sistem.....	18
BAB 4 PENGUJIAN DAN ANALISIS	21
4.1 Data	21
4.2 Pengujian Sistem	22
4.3 Skenario Pengujian.....	22
4.4 Hasil Simulasi	22
4.4.1 Analisis Portofolio investasi pada 10 saham	23
4.4.2 Analisis Portofolio investasi pada 20 saham	26
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARA	30
5.1 Kesimpulan.....	30
5.2 Saran.....	30
DAFTAR PUSTAKA	31
LAMPIRAN.....	33
L.1.1 Data 20 Saham Indeks LQ45	33