

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN ORISINALITAS	ii
ABSTRAK.....	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
KATA PENGANTAR	v
LEMBAR PERSEMBAHAN	vi
DAFTAR ISI.....	vii
BAB I.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	1
1.3 Tujuan Penelitian	2
1.4 Batasan Masalah	2
1.5 Metodologi Penelitian	2
1.6 Sistematika Penulisan.....	3
BAB II.....	4
2.1 Investasi	4
2.1.1 <i>Return</i>	4
2.1.2 <i>Expected Return</i>	5
2.1.3 Risiko	5
2.2 LQ 45	7
2.3 Portofolio	8
2.2.1 <i>Return</i> portofolio	8
2.2.2 Risiko Portofolio	9
2.3 Metode <i>Mean Variance</i>	9
2.4 Metode <i>Homogeneous Constraints</i>	11
2.5 <i>Sharpe Ratio</i>	12
BAB III.....	13
3.1 Gambaran Umum Sistem	13
3.1.1 Pembagian Saham	15
3.2 <i>Mean Variance</i> dan <i>Homogeneous Constraints</i>	15

3.2.1 <i>Mean Variance</i>	15
3.2.2 <i>Homogeneous Constraints</i>	17
3.3 Pembentukan Portofolio dan Pengujian/Evaluasi	18
BAB IV	20
4.1 Pengujian Sistem.....	20
4.2 Rencana Pengujian	20
4.2.1 <i>Return</i> Portofolio.....	20
4.2.2 Risiko Portofolio	20
4.2.3 <i>Sharpe Ratio</i>	20
4.3 Analisis Hasil Pengujian	21
4.3.1 Analisis <i>Return</i> Portofolio.....	21
4.3.2 Analisis Risiko Portofolio	22
4.3.3 Analisis <i>Sharpe Ratio</i> Portofolio	24
BAB V	27
5.1. Kesimpulan	27
5.2. Saran	27
DAFTAR PUSTAKA	28
LAMPIRAN A: Daftar Saham Indeks LQ45 Periode Agustus 2013-Januari 2014	29
LAMPIRAN B: Daftar Pembagian portofolio.....	30
LAMPIRAN C: Daftar Nilai Bobot Portofolio	31
LAMPIRAN D: Grafik Pergerakan Saham Indeks LQ45	33
LAMPIRAN E: Nilai Rata-rata <i>Return</i> Data Historis	34
LAMPIRAN F: Nilai Rata-rata <i>Return</i> Portofolio Data Uji	36
LAMPIRAN G: Nilai Rata-rata Risiko Portofolio Data Historis	38
LAMPIRAN H: Nilai Rata-rata Risiko Portofolio Data Uji.....	40
LAMPIRAN I: Nilai <i>Sharpe Ratio</i> Data Historis.....	42
LAMPIRAN J: Nilai <i>Sharpe Ratio</i> Data Uji	44