

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Batasan Masalah.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Investasi Saham	9
2.2 <i>Return</i> dan Risiko Saham	9
2.3 <i>Short-selling</i>	11
2.4 <i>Quadratic Programming</i>	13
2.5 Pembentukan Portofolio Saham	17
2.5.1 Seleksi Saham untuk Portofolio dengan Koefisien Korelasi	18
2.5.2 <i>Return</i> dan Risiko Portofolio	20
2.5.3 Portofolio <i>Mean-Semivariance</i>	22

2.5.4	Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> tanpa <i>Short-Selling</i>	29
2.6	<i>Value at Risk</i> Metode <i>Historical Simulation</i>	30
2.7	Kinerja Portofolio	31
2.8	<i>Graphical User Interface</i> (GUI) Python dengan <i>Streamlit</i>	32
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....		36
3.1	Jenis dan Sumber Data	36
3.2	Variabel Penelitian.....	36
3.3	Tahapan Analisis Data	36
3.4	Diagram Alir Analisis Data	38
3.5	Diagram Alir Pembuatan GUI.....	40
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		41
4.1	<i>Return</i> Saham	41
4.2	Analisis Deskriptif <i>Return</i> Saham.....	43
4.3	Deskripsi Variabel Penelitian	45
4.4	Seleksi Saham.....	45
4.5	Pembentukan Portofolio <i>Mean-Semivariance</i>	47
4.6	Pembentukan Portofolio <i>Mean-Semivariance</i> tanpa <i>Short-Selling</i>	53
4.7	Perhitungan <i>Return</i> Portofolio Saham.....	55
4.8	Perhitungan VaR dengan metode <i>Historical Simulation</i>	56
4.9	Kinerja Portofolio	57
4.10	<i>Graphical User Interface</i> (GUI) Python dengan <i>Streamlit</i>	58
4.10.1	Perancangan UI dengan <i>Sidebar Navigation</i>	58
4.10.2	Perancangan Halaman Home	59
4.10.3	Perancangan Halaman Pilih Saham	59

4.10.4	Perancangan Halaman Analisis <i>Return</i> Saham	60
4.10.5	Perancangan Halaman Seleksi Saham	62
4.10.6	Perancangan Halaman Bobot Portofolio <i>Mean-Semivariance QP</i> .	65
4.10.7	Perancangan Halaman <i>Value at Risk</i>	66
4.10.8	Perancangan Halaman Kinerja Portofolio.....	68
BAB V KESIMPULAN		69
DAFTAR PUSTAKA		71
LAMPIRAN.....		75