

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	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	4
1.3 Batasan Masalah.....	5
1.4 Tujuan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Investasi.....	7
2.2 Pasar Modal.....	9
2.3 Saham.....	10
2.4 Indeks Saham <i>Small-Mid Cap Composite</i> (IDXSMC-COM).....	10
2.5 <i>Return</i> Saham.....	11
2.6 Risiko Saham	13

2.7	Momen	15
2.8	Matriks	22
2.9	Kronecker-Product	23
2.10	Portofolio Saham.....	24
2.11	Teori Portofolio Modern	25
2.12	Peran Momen Lebih Tinggi dalam Pemilihan Portofolio	27
2.13	Definisi Umum dalam dalam Kerangka Model Portofolio Saham <i>Mean-Variance-Skewness-Kurtosis</i>	29
2.13.1	<i>Return</i> Portofolio.....	30
2.13.2	Varians Portofolio	31
2.13.3	<i>Skewness</i> Portofolio	32
2.13.4	<i>Kurtosis</i> Portofolio	34
2.14	<i>Polynomial Goal Programming</i> (PGP) untuk Optimalisasi Portofolio dalam Kerangka Empat Momen.....	36
2.15	Perhitungan Kinerja Portofolio dengan Indeks Sharpe	40
BAB III METODE PENELITIAN.....		42
3.1	Jenis dan Sumber Data	42
3.2	Variabel Penelitian	42
3.3	Tahapan Analisis Data	43
3.4	Diagram Alir Analisis Data.....	44
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		45
4.1	Pemilihan Saham Penyusun Portofolio	45
4.2	Statistika Deskriptif Saham.....	48

4.3	Nilai Optimum untuk Masing-Masing Subproblem	53
4.4	Menerapkan Model <i>Polynomial Goal Programming</i>	54
4.5	Perhitungan Indeks Sharpe.....	58
BAB V KESIMPULAN		61
DAFTAR PUSTAKA		xiii
LAMPIRAN		xxiv