

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Batasan Masalah	5
1.4 Tujuan	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	7
2.1 Investasi Saham	7
2.2 Evaluasi Kinerja Keuangan.....	8
2.3 ELECTRE-III.....	9
2.4 <i>Return</i> Saham.....	13
2.5 Risiko Saham	14
2.6 <i>Skewness Return</i> Saham.....	15
2.7 <i>Kurtosis Return</i> Saham	17
2.8 Model Portofolio <i>Mean-Variance-Skewness-Kurtosis</i> (MVSK)	18
2.9 Newton-Raphson.....	25
2.10 <i>Value at Risk Historical Simulation</i>	29
BAB III METODE PENELITIAN.....	30
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	30
3.2 Variabel Penelitian.....	30
3.3 Tahapan Analisis Data	31
3.4 Diagram Alir Analisis Data	31

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	33
4.1 <i>Return</i> Saham.....	33
4.2 ELECTRE-III.....	37
4.3 Portofolio Optimal <i>Mean-Variance-Skewness-Kurtosis</i> (MVSK).....	40
4.4 Pengukuran Risiko Portofolio.....	52
BAB V PENUTUP	55
5.1 Kesimpulan	55
5.2 Saran	55
DAFTAR PUSTAKA.....	57
LAMPIRAN.....	63