

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	6
1.3 Batasan Masalah.....	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1 Saham	8
2.2 Investasi.....	8
2.3 Indeks SRI-KEHATI	9
2.4 Portofolio.....	9
2.5 Return	10
2.5.1 <i>Expected Return</i> Saham.....	10

2.5.2	<i>Return</i> Portofolio	11
2.5.3	<i>Expected Return</i> Portofolio	12
2.6	Risiko Portofolio	13
2.7	Ukuran Kinerja Portofolio.....	15
2.8	<i>Genetic Algorithm</i>	16
2.8.1	Representasi Solusi.....	17
2.8.2	Fungsi <i>Fitness</i>	18
2.8.3	Optimasi Portofolio Menggunakan <i>Genetic Algorithm</i>	18
2.9	<i>Value at Risk</i> Cornish-Fisher Expansion	24
2.10	Ilustrasi Proses <i>Genetic Algorithm</i> Pada Optimasi Portofolio	26
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....		31
3.1	Jenis dan Sumber Data	31
3.2	Variabel Penelitian.....	31
3.3	Tahapan Analisis Data	32
3.4	Diagram Alir Analisis Data	33
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		34
4.1	Deskripsi Data	34
4.2	Menghitung <i>Return</i> Tiap Saham.....	36
4.3	<i>Expected Return</i> Saham.....	36
4.4	Bobot dan VaR untuk 5 Saham dengan E(R) Tertinggi	38
4.4.1	Matriks Varian Kovarian	39

4.4.2 Pembentukan Bobot Portofolio dengan <i>Genetic Algorithm</i>	39
4.4.3 Pengukuran VaR Cornish-Fisher Expansion	42
4.5 Ringkasan Hasil GA dan VaR untuk Variasi Banyaknya Saham.	43
BAB V PENUTUP	47
5.1 Kesimpulan.....	47
5.2 Saran	48
DAFTAR PUSTAKA	49
LAMPIRAN	52