

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN .....	iii
HALAMAN PENGESAHAN I .....	iv
HALAMAN PENGESAHAN II .....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR ISI .....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR TABEL .....	xiii
DAFTAR SINGKATAN DAN LAMBANG .....	xiv
ABSTRAK .....	xvii
ABSTRACT .....	xviii
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	3
1.3 Pembatasan Masalah .....	3
1.4 Tujuan Penelitian .....	3
1.5 Manfaat Penelitian .....	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LANDASAN TEORI .....	5
2.1 Tinjauan Pustaka .....	5
2.2 Model Portofolio Saham .....	12
2.3 Metode Lagrange .....	27
2.4 Pengujian Normalitas Data .....	29
2.5 <i>Value at Risk</i> (VaR) .....	31
2.6 <i>Conditional Value at Risk</i> (CVaR) .....	32
BAB III METODE PENELITIAN .....	34
3.1 Waktu dan Jenis Penelitian .....	34
3.2 Prosedur Penelitian .....	35
3.3 Diagram Alur Penelitian .....	37

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....	39
4.1 Pengembangan Model Matematis dan Integrasi Metode Lagrange ....	39
4.2 Pengumpulan Data .....	55
4.3 Pengolahan Data .....	56
4.4 Perhitungan Parameter Statistik .....	60
4.5 Optimasi Portofolio dengan Metode Lagrange .....	63
4.6 Evaluasi Risiko dan Kinerja Portofolio .....	66
BAB V PENUTUP .....	70
5.1 Kesimpulan .....	70
5.2 Saran .....	71
DAFTAR PUSTAKA .....	72
LAMPIRAN .....	75