

# DAFTAR ISI

<b>LEMBAR PENGESAHAN</b> .....	<b>i</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN</b> .....	<b>ii</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>iii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>iv</b>
<b>LEMBAR PERSEMBAHAN</b> .....	<b>v</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>x</b>
<b>1. Pendahuluan</b> .....	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Rumusan Masalah .....	2
1.3. Tujuan .....	2
1.4. Batasan Masalah .....	2
1.5. Metodologi Penelitian .....	2
1.6. Sistematika Penulisan Tugas Akhir .....	3
<b>2. Tinjauan Pustaka</b> .....	<b>5</b>
2.1. Saham .....	5
2.1.1. Indeks Harga Saham .....	6
2.1.2. Indeks LQ45 .....	6
2.2. <i>Return, Expected Return</i> dan Risiko Saham .....	6
2.2.1. <i>Return</i> .....	6
2.2.2. <i>Expected Return</i> .....	7
2.2.3. Risiko .....	7
2.3. Portofolio Saham .....	8
2.3.1. <i>Expected Return</i> Portofolio .....	8

2.2.3. Risiko Portofolio .....	9
2.4. Metode Portofolio <i>Mean-Variance</i> .....	9
2.4.1. <i>Efficient frontier</i> .....	10
2.5. Optimisasi <i>Multi-objective</i> .....	11
2.5.1. <i>Dominance Test</i> .....	11
2.6. Strength Pareto Evolutionary Algorithm II (SPEA-II).....	12
<b>3. Rancangan Sistem.....</b>	<b>16</b>
3.1. Deskripsi Umum.....	16
3.1.1. Identifikasi Masalah .....	16
3.1.2. Teknik Pengumpulan Data.....	16
3.2. Perancangan Sistem.....	18
3.3. Penerapan Algoritma Genetika <i>Multi-objective</i> SPEA-II .....	19
<b>4. Implementasi Pengujian Sistem dan Analisis .....</b>	<b>24</b>
4.1. Pengujian Sistem .....	24
4.2. Tujuan Pengujian Sistem.....	24
4.3. Skenario Pengujian.....	24
4.3.1. Skenario 1 .....	24
4.3.2. Skenario 2 .....	25
4.3.3. Skenario 3 .....	25
4.4. Analisis Hasil Pengujian .....	25
4.4.1. Hasil dan Analisis .....	26
4.4.2. Perbandingan dan Analisis skenario 1, 2 dan 3.....	34
<b>5. Kesimpulan dan Saran .....</b>	<b>41</b>
5.1. Kesimpulan.....	41
5.2. Saran.....	41
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>42</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>43</b>

