

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
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	3
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	5
2.1 Investasi	5
2.2 Saham	5
2.3 Indeks Harga Saham	5
2.3.1 Indeks LQ45	6
2.4 Diversifikasi Portofolio	6
2.5 Volatilitas Harga Saham	6

2.6 <i>Return, Expected Return, dan Risiko Saham</i>	7
2.6.1 <i>Return</i>	7
2.6.2 <i>Expected Return</i>	7
2.6.3 <i>Covariance Return</i>	8
2.6.4 <i>Risiko</i>	8
2.7 <i>Metode Sequential Quadratic Programing</i>	9
2.8 <i>Portofolio Equally Risk Contribution (ERC)</i>	10
2.8.1 <i>Definisi Portofolio ERC</i>	10
2.8.2 <i>Sifat Teoritis dari Portofolio ERC</i>	11
2.9 <i>Perbandingan Portofolio ERC , MV, dan EW</i>	12
2.9.1 <i>Metode Mean Variance</i>	12
2.9.2 <i>Metode Equally Weight</i>	12
2.9.3 <i>Perbandingan Portofolio ERC, MV, dan EW</i>	13
2.10 <i>Expected Return Portofolio</i>	13
BAB 3 PERANCANGAN SISTEM	14
3.1 <i>Diskripsi Sistem</i>	14
3.2 <i>Model Pemecahan Masalah</i>	14
3.3 <i>Data</i>	15
3.4 <i>Identifikasi Parameter</i>	16
3.5 <i>Hitung Bobot Dengan Penyelesaian Optimasi</i>	16
3.6 <i>Pengujian Bobot ERC</i>	17
3.7 <i>Hitung Bobot Portofolio MV dan EW</i>	17
3.8 <i>Pengujian Kinerja Portofolio ERC Terhadap Portofolio MV dan EW</i>	17

BAB 4 IMPLEMENTASI PENGUJIAN SISTEM DAN ANALISIS	19
4.1 Pengujian Sistem	19
4.2 Tujuan Pengujian Sistem	19
4.3 Skenario Pengujian	19
4.3.1 Skenario 1	19
4.3.2 Skenario 2	23
4.4 Perbandingan dan Analisis Kedua Skenario	28
4.4.1 Hasil Pengujian Dan Analisis	29
4.5 Perbandingan Nilai portofolio MV, ERC, dan EW.....	29
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	32
5.1 Kesimpulan	32
5.2 Saran	32
DAFTAR PUSTAKA	33
LAMPIRAN	35