

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN.....	iii
ABSTRAK.....	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
LEMBAR PERSEMBAHAN	vi
UCAPAN TERIMA KASIH.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL	xii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	2
1.3 Batasan Masalah.....	2
1.4 Tujuan.....	3
1.5 Metodologi Penyelesaian Masalah	3
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	4
2.1 Saham	4
2.2 Definisi Risiko Portofolio.....	4
2.3 Definisi Investasi	4
2.4 Indeks Saham LQ45	5
2.5 <i>Return</i> Saham	5
2.6 <i>Expected Return</i>	5
2.7 Variansi <i>Return</i> Saham.....	6
2.8 <i>Value-at-Risk</i>	6
2.9 <i>Maximum Likelihood Estimation (MLE)</i>	7
2.10 Metode Newton Raphson Jacobian	8
2.11 Model PVaREVT	9
2.12 Algoritma Genetika	11
2.12.1 Inialisasi Populasi.....	12
2.12.2 Representasi Kromosom.....	13
2.12.3 Evaluasi	13
2.12.4 Seleksi Orang Tua.....	14

2.12.5	Pindah Silang	14
2.12.6	Mutasi Gen.....	14
2.13	<i>Mean Absolute Error</i> (MAE)	15
2.14	Nilai Portofolio	15
2.14.1	Bobot Optimal Portofolio	15
BAB 3	PERANCANGAN SISTEM	16
3.1	Deskripsi Umum Sistem.....	16
3.2	Gambaran Umum Penelitian	16
3.3	Proses Perancangan Sistem	17
3.4	Mengumpulkan Data Historis.....	18
3.5	<i>Preprocessing</i> Data	19
3.6	Perhitungan Batas Ambang	19
3.7	Implementasi Algoritma Genetika	19
3.7.1	Pengujian Kembali (<i>Backtesting</i>).....	20
3.7.2	Fungsi Fitness.....	20
3.8	Perhitungan Nilai Portofolio.....	21
3.9	Dokumentasi Hasil	21
BAB 4	HASIL DAN ANALISIS PENGUJIAN.....	22
4.1	Implementasi Sistem	22
4.1.1	Tujuan Implementasi Sistem.....	22
4.2	Skenario Pengujian Sistem	22
4.3	Hasil Pengujian.....	23
4.3.1	Nilai <i>Mean Absolute Error</i> (MAE) <i>Training</i> dan <i>Testing</i>	23
4.3.2	Nilai <i>Value-at-Risk</i> (VaR).....	24
4.3.3	Skenario Portofolio	25
4.4	Analisis Hasil Pengujian.....	27
BAB 5	KESIMPULAN DAN SARAN	28
5.1	KESIMPULAN	28
5.2	SARAN.....	28
DAFTAR PUSTAKA	29
LAMPIRAN.....	30