

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR SIMBOL	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Batasan Masalah.....	3
1.4 Tujuan Penelitian.....	3
1.5 Sistematika Penulisan.....	4
BAB II LANDASAN TEORI	5
2.1 Pasar Modal.....	5
2.1.1 Bursa Efek Indonesia (BEI).....	5
2.1.2 Jakarta Islamic Index (JII)	6
2.1.3 LQ-45	6
2.5 Distribusi Probabilitas	7
2.5.1 Distribusi Normal	8
2.5.2 Uji Normalitas Kolmogorov-Smirnov	10
2.8 Saham	11
2.8.1 Emiten.....	12
2.8.2 Kode Saham.....	12
2.8.3 Jenis Saham.....	12
2.9 Investasi.....	13
2.9.1 Investor	13
2.9.2 Landasan Syar'i Investasi	14
2.10 Portofolio.....	15
2.10.1 Optimalisasi Portofolio	16
2.10.2 Portofolio Efisien.....	16

2.13 Analisis Rasio Profitabilitas Perusahaan	17
2.14 Return Saham	17
2.15 Risiko Saham.....	19
2.15.1 Risiko Portofolio.....	21
2.15.2 Value at Risk (VaR).....	21
2.16 Ekspektasi.....	22
2.17 Mean	23
2.18 Variansi.....	23
2.19 Kovariansi.....	23
2.20 <i>Pareto Optimality</i>	24
2.21 Multi-Objective Optimization Problem (MOOP)	25
2.21.1 Linier dan Nonlinier Multi-Objective Optimization Problem (MOOP)	25
2.21.2 Konveks dan Nonkonveks Multi-Objective Optimization Problem (MOOP)	26
2.22 Matriks Varian Kovarian	26
2.23 Turunan Parsial.....	27
2.23.1 Turunan Parsial Pertama.....	27
2.23.2 Turunan Parsial Derajat Dua.....	28
2.24 Fungsi Lagrange	28
2.24.1 Satu Pengali <i>Lagrange</i>	28
2.24.2 Lebih dari Satu Pengali <i>Lagrange</i>	29
2.25 <i>Short Sale Masyir</i>	29
BAB III PENERAPAN OPTIMISASI MULTIOBJEKTIF PORTOFOLIO	
SAHAM PADA INDUSTRI KEUANGAN.....	31
3.1 Formulasi Multiobjektif.....	31
3.2 Tahapan Penerapan Optimisasi Multiobjektif	36
3.3 Flowchart.....	38
BAB IV STUDI KASUS DAN ANALISA	40
4.1 Deskripsi Data	40
4.2 Pemilihan Sampel.....	40
4.3 <i>Return Saham</i>	40
4.4 Uji Normalitas <i>Kolmogorov-Smirnov</i>	42
4.5 Pemilihan Portofolio.....	44
4.6 Pembentukan Portofolio dengan Pendekatan Optimisasi Multibjektif	48
4.6.1 Perhitungan Bobot Saham <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	49
4.6.2 Perhitungan Bobot Saham LQ-45.....	64
4.7 Perhitungan Keuntungan Portofolio	75
4.8 Perhitungan <i>Value at Risk</i>	77
4.9 Portofolio Optimal Saham <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	79
4.10 Portofolio Optimal Saham LQ45.....	80

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	81
5.1 Kesimpulan.....	81
5.2 Saran	83
DAFTAR PUSTAKA	84
LAMPIRAN-LAMPIRAN	
RIWAYAT HIDUP	