

## DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN

LEMBAR PENGESAHAN

PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI

ABSTRAK .....	i
ABSTRACT .....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI .....	v
DAFTAR GAMBAR.....	vii
DAFTAR TABEL .....	viii
DAFTAR LAMPIRAN .....	ix
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	3
1.3 Batasan Masalah .....	3
1.4 Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	4
1.5 Metode Penelitian .....	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
<b>BAB II LANDASAN TEORI.....</b>	<b>6</b>
2.1 Investasi Saham Syariah.....	6
2.2 Portofolio .....	8
2.3 <i>Return</i> .....	9
2.4 Risiko.....	11
2.5 Pemrograman Linier.....	12
2.6 <i>Goal Programming</i> .....	14
2.7 <i>Value at Risk</i> .....	16
2.8 Metode <i>Variance-Covariance</i> .....	17
2.9 Penelitian Terdahulu .....	19

<b>BAB III PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL DENGAN LEXICOGRAPHIC GOAL PROGRAMMING SERTA PERHITUNGAN RISIKO DENGAN EXPECTED SHORTFALL.....</b>	<b>21</b>
3.1 <i>Lexicographic Goal Programming</i> .....	21
3.2 <i>Expected Shortfall</i> .....	23
3.3 Volatilitas.....	26
3.4 Uji Asumsi.....	27
3.5 Koefisien Variasi.....	29
3.6 Indeks Sharpe.....	30
3.7 Alur Penelitian .....	31
<b>BAB IV STUDI KASUS DAN ANALISA .....</b>	<b>32</b>
4.1 Data Penelitian .....	32
4.2 Uji Asumsi .....	34
4.3 Pemilihan Saham.....	36
4.4 Pembentukan Portofolio dengan <i>Lexicographic Goal Programming</i> .....	41
4.5 Perhitungan <i>Value at Risk</i> .....	50
4.6 Perhitungan <i>Expected Shortfall</i> .....	51
<b>BAB V PENUTUP .....</b>	<b>54</b>
5.1 Kesimpulan .....	54
5.2 Saran .....	55
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>56</b>
<b>RIWAYAT HIDUP.....</b>	<b>58</b>
<b>LAMPIRAN</b>	