

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI TUGAS AKHIR UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS	v
ABSTRAK	vi
<i>ABSTRACT</i>	vii
MOTTO	viii
PERSEMBAHAN.....	ix
KATA PENGANTAR	xi
DAFTAR ISI.....	xiii
DAFTAR TABEL	xvii
DAFTAR GAMBAR	xviii
DAFTAR SIMBOL.....	xix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Batasan Masalah.....	4
1.4 Tujuan Penelitian.....	4
1.5 Manfaat.....	4
1.6 Sistematika	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	6
2.1 Program Linear.....	6
2.1.1 Definisi Program Linear	6
2.1.2 Bentuk Matematis Program linear	6

2.1.3 Jenis Kasus Program Linear	7
2.1.4 Metode Simpleks	7
2.2 Masalah Optimisasi Multi Objektif	9
2.2.1 Definisi Masalah Optimisasi Multi Objektif	9
2.2.2 Bentuk Matematis Multi Objektif	9
2.2.3 Program Linear Multi Objektif	10
2.3 Optimal Pareto	10
2.3.1 Solusi Optimal Lengkap	10
2.3.2 Solusi Optimal Pareto	10
2.3.3 Solusi Optimal Pareto Lemah	10
2.4 Pareto <i>Front</i> dan Konsep Dominasi	11
2.5 Metode <i>Weighted Sum</i>	12
2.5.1 Metode <i>Weighted Sum</i>	12
2.5.2 Normalisasi Fungsi Tujuan	13
2.5.3 Contoh <i>Weighted Sum</i>	14
2.6 Saham	18
2.6.1 Pengertian Saham	18
2.6.2 Indeks Saham	19
2.6.3 Investasi	19
2.6.4 Portofolio	19
2.6.5 <i>Return</i>	20
2.6.6 <i>Expected Return</i>	20
2.6.7 Variansi	20
2.6.8 Kovarian	21
2.6.9 Koefisien Risiko	21
2.6.10 Rasio	21

2.6.11 <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	22
BAB III METODE PENELITIAN.....	23
BAB IV PEMBAHASAN.....	26
4.1 Data Saham <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	26
4.2 Pengolahan Data.....	28
4.2.1 <i>Return</i>	29
4.2.2 <i>Expected Return</i>	30
4.2.3 <i>Return</i> Pasar dan <i>Expected Return</i> Pasar.....	33
4.2.4 Kovariansi dan Variansi.....	36
4.2.5 Nilai Variansi Pasar.....	37
4.2.6 Nilai Koefisien Risiko.....	38
4.2.7 Rasio.....	39
4.2.8 Memilih 6 rasio tertinggi.....	41
4.3 Pemodelan Pemrograman Linear Multi Objektif.....	42
4.3.1 Membuat variabel keputusan.....	42
4.3.2 Membuat Fungsi Tujuan.....	42
4.3.3 Membuat Fungsi Kendala.....	43
4.4 Metode <i>Weighted Sum</i>	43
4.4.1 Normalisasi Fungsi Tujuan.....	43
4.4.2 Pemodelan Metode <i>Weighted Sum</i>	46
4.4.3 Pemilihan nilai bobot ke-i.....	46
4.4.4 Solusi Penyelesaian <i>Weighted Sum</i>	55
4.4.5 Analisis Hasil <i>Weighted Sum</i>	56
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	58
5.1 Simpulan.....	58
5.2 Saran.....	59

DAFTAR PUSTAKA	60
LAMPIRAN.....	63

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Tabel awal metode simpleks	8
Tabel 2.2 Hasil nilai z_1 dan z_2	16
Tabel 2.3 Hasil nilai z_1 dan z_2	18
Tabel 4.1 Nama emiten saham ke - i	26
Tabel 4.2 Rincian waktu pengambilan data	27
Tabel 4.3 Nilai <i>return</i> saham BRPT	29
Tabel 4.4 Nilai <i>expected return</i>	31
Tabel 4.5 Nilai <i>expected return</i> positif	33
Tabel 4.6 Nilai <i>return</i> pasar	34
Tabel 4.7 Nilai kovariansi	36
Tabel 4.8 Nilai koefisien risiko	39
Tabel 4.9 Nilai rasio	40
Tabel 4.10 Nilai rasio tertinggi	41
Tabel 4.11 Data nilai <i>expected return</i> dan koefisien risiko	41
Tabel 4.12 Rincian bobot yang digunakan	46
Tabel 4.13 Solusi <i>weighted sum</i>	55

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Konsep dominasi	11
Gambar 2.2 Grafik <i>historical performance</i>	22
Gambar 3.1 Diagram alir 1.....	25
Gambar 3.2 Diagram alir 2.....	25
Gambar 4.1 Hasil <i>weighted sum</i>	56

DAFTAR SIMBOL

x	: Variabel keputusan
b	: Kapasitas kendala (ruas kanan)
Z	: Fungsi tujuan yang dinormalisasi
w	: Nilai bobot yang diberikan pada fungsi tujuan
z	: Fungsi tujuan sebelum dinormalisasi
a	: Nilai koefisien
R	: Tingkat pengembalian (<i>return</i>)
S	: Harga saham
$E(R)$	: Nilai <i>expected return</i>
n	: Jumlah periode melakukan pengamatan.
σ^2	: Nilai variansi
Cov	: Nilai kovariansi <i>return</i>
β	: Koefisien risiko saham
$Rasio$	: <i>Rasio</i> saham

Subscript

j	: Komponen ke – j
i	: Komponen ke – i
k	: Komponen ke - k
t	: Waktu ke – t
i, t	: Saham ke – i saat waktu ke - t
m	: Saham pasar