

DAFTAR ISI

ABSTRAK	ii
ABSTRACT	iii
LEMBAR PENGESAHAN	iv
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR TABEL	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
I.1 Latar Belakang	1
I.2 Rumusan Masalah	5
I.3 Tujuan Penelitian	5
I.4 Manfaat Penelitian	6
I.5 Batasan dan Asumsi Penelitian	6
I.6 Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	9
II.1 Kajian Teori	9
II.1.1 Investasi.....	9
II.1.2 Saham	10
II.1.3 <i>Return</i>	11
II.1.4 Risiko.....	12
II.1.5 Volatilitas	12
II.1.6 Distribusi Normal	13
II.1.7 <i>QQ Plot</i>	13
II.1.8 Uji Normalitas Kolmogorov-Smirnov.....	14
II.1.9 Simulasi Monte Carlo.....	14
II.1.10 Model Pergerakan Harga <i>Geometric Brownian Motion</i> (GBM).....	15
II.1.11 Korelasi Pearson, <i>Scatterplot</i> , dan Regresi Linear	16
II.1.12 <i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE).....	18

II.1.13	<i>Value at Risk</i>	19
II.1.14	<i>Back Testing</i>	22
II.1.15	<i>Mean-Variance Optimization</i>	24
II.1.16	<i>Bootstrapping</i>	26
II.1.17	<i>One-Way ANOVA & Post Hoc Test</i>	27
II.1.18	<i>Dashboard</i>	28
II.1.19	<i>Streamlit Framework</i>	29
II.2	Penelitian Terdahulu	32
BAB III	METODE PENYELESAIAN MASALAH	36
III.1	Sistematika Penyelesaian Masalah	36
III.1.1	Tahap Pendahuluan	38
III.1.2	Tahap Pengumpulan Data dan Pemilihan Sampel	39
III.1.3	Tahap Identifikasi Karakteristik Data	44
III.1.4	Tahap Pemodelan dan Simulasi	45
III.1.5	Tahap Verifikasi dan Validasi.....	45
III.1.6	Tahap Analisis Hasil Model dan Simulasi	46
BAB IV	PENYELESAIAN MASALAH	47
IV.1	Pengumpulan dan Pengolahan Data.....	47
IV.2	Pembentukan Awal <i>Environment</i>	53
IV.3	<i>Correlation Heatmap</i>	57
IV.4	Prediksi Harga Saham dengan Model <i>Geometric Brownian Motion</i> dan Perhitungan <i>Value at Risk</i> (VaR).....	58
IV.5	Pembentukan <i>Mean Variance Portfolio</i>	64
IV.6	Verifikasi.....	69
IV.7	Pembacaan Keputusan pada Model	70
BAB V	VALIDASI, ANALISIS HASIL, DAN IMPLIKASI	72
V.1	Validasi	72
V.1.1	Uji Visual dan Statistik Korelasi <i>Log Return</i> Saham BBKA dan BNGA	72
V.1.2	<i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE).....	73
V.1.3	<i>Backtesting</i>	81
V.1.4	Validasi Sampel Portofolio Terbentuk	86

V.2	Skenario Portofolio	88
V.2.1	Skenario 1	88
V.2.2	Skenario 2	90
V.2.3	Skenario 3	90
V.3	Pemilihan Portofolio dan Risiko Aset Individu	91
V.4	Implikasi	94
V.4.1	Implikasi terhadap Evaluasi Risiko	95
V.4.2	Implikasi bagi Investor Individu	95
V.4.3	Implikasi terhadap Literasi dan Edukasi Keuangan	96
BAB VI	KESIMPULAN DAN SARAN	97
VI.1	Kesimpulan	97
VI.2	Saran	97
DAFTAR PUSTAKA.....		98
LAMPIRAN.....		105