

Kinerja dan optimalisasi portofolio investasi pada PT IHT = PT IHT investment portfolio performance and optimization

Laydra Utama Dwi S., author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20350946&lokasi=lokal>

Abstrak

Laporan magang ini membahas proses investasi yang dilakukan oleh PT IHT, sebuah perusahaan asuransi jiwa yang berperan sebagai investor institusi. Alokasi dana pada proses investasi ditempatkan pada berbagai instrumen seperti saham, deposito, obligasi, dan reksadana. Proses investasi yang dilakukan bertujuan untuk memperoleh return yang tinggi untuk menambah pendapatan perusahaan. Dengan demikian perlu dilakukan pembentukan portofolio untuk memaksimalkan return serta meminimalisir risiko. Pada laporan magang ini peneliti membandingkan kinerja portofolio investasi PT IHT dengan berbagai indeks yang ada di Indonesia. Peneliti juga melakukan uji coba untuk memperoleh portofolio yang memberikan kinerja yang lebih baik dari PT IHT.

This internship report discusses the investment process which had made by PT IHT, the life insurance company as institutional investors. The allocation of funds in the investment process placed on various instruments such as stock, bonds, deposits, and mutual funds. The aims of investment process is to earn high return for increasing the company's revenue. The company must make best portfolio to maximize return and minimize risk. In this internship report, the researcher compared performance of PT IHT investment portfolio with various investment indices in Indonesia. The researcher conduct trials to obtain a optimum portfolio that gives better performance from PT IHT.