

Optimalisasi portofolio saham pada dana pensiun pemberi kerja (studi kasus dana pensiun Jasa Tirta II) = Optimization of stock portfolio in pension fund (case study Jasa Tirta II pension fund)

Muhamad Avicenna, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20415930&lokasi=lokal>

Abstrak

Dana Pensiun merupakan badan hukum yang mengelola dan menjalankan program yang menjanjikan manfaat pensiun bagi pesertanya. Dalam memenuhi kewajiban yang harus di penuhi terhadap pesertanya, dana pensiun mempunyai tugas untuk mengembangkan dana yang telah di himpun dari peserta, dengan salah satu caranya yaitu investasi. Penyusunan portofolio dana pensiun mengedepankan keamanan investasi. Penelitian menggunakan konsep dasar pembentukan portofolio optimal dengan metode Model Markowitz. Optimal dalam penelitian ini disesuaikan dengan arahan investasi Dana Pensiun Jasa Tirta II yaitu memberikan return tinggi dengan tingkat risiko rendah. Untuk jumlah proporsi penempatan investasi juga di batasi oleh peraturan kementerian keuangan yaitu penempatan per saham individu tidak boleh melebihi 20% dari total investasi.

Hasil penelitian ini adalah diperolehnya tingkat return yang tinggi dengan risikoyang rendah dibandingkan dengan portofolio yang ada. Sehingga investor dapat menjadikan hasil penelitian sebagai bahan pertimbangan dalam melakukan investasi.

Pension funds is a legal entity that manages and run the program which promises pension benefits for the participants .In fulfilling obligations which must be in to meet participants, pension funds have a duty to develop the funds already acquired from participants, with one way that is investment. The portfolio pension fund investment security puts forward.

Research using the basic concept formation in markowitz model portfolio optimal method.Optimal research is adjusted to the referral investment fund pension jasa tirta ii is providing high levels of low risk and return.So the proportion of the investment was also at the limit by the financial regulation is at stake for individuals may not exceed 20 % of the total investment.

The result of this research is procures the risks that based on the level of return high relative to a portfolio which exist.Investors able to raise the results of research as a consideration in conduct infestation.