

Pembentukan portofolio optimal pada saham-saham di negara emerging market Asia Tenggara = Building an optimal portfolio in Southeast Asia emerging market countries stocks / Bagus Adriawan Oktaviano

Bagus Adriawan Oktaviano, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20433976&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Tujuan dari penulisan karya akhir ini adalah untuk mengetahui portofolio optimal atas saham-saham di negara-negara emerging market Asia Tenggara yang diwakili oleh indeks LQ45 untuk Indonesia, indeks FBM KLCI untuk Malaysia, indeks SET50 untuk

Thailand dan indeks PSEi untuk Filipina dengan menggunakan metode Mean-Variance Markowitz. Selain itu penelitian ini juga menganalisa apakah melakukan diversifikasi pada pasar saham di negara-negara emerging market Asia Tenggara dapat memberikan manfaat bagi investor, terutama investor dari Indonesia, Malaysia, Thailand dan Filipina sendiri. Hasil penelitian menunjukkan bahwa portofolio optimal atas gabungan saham-saham di negara emerging market Asia Tenggara dapat menghasilkan portofolio yang paling efisien dengan rasio Sharpe yang lebih besar daripada portofolio optimal di Indonesia, Malaysia, Thailand dan Filipina, oleh karena itu berinvestasi di negara-negara emerging market Asia Tenggara dapat memberikan manfaat bagi investor dari Indonesia, Malaysia, Thailand dan Filipina.

<hr>

ABSTRACT

The purpose of this research is to define the optimum portfolio of stocks in Southeast Asia emerging market countries by using LQ45 index from Indonesia, FBM KLCI index from Malaysia, SET50 index from Thailand and PSEi index from Philippines. The method that used to define the optimum portfolio is the Markowitz's Mean-Variance. The other purpose of this research is to analyze whether diversification in Southeast Asia emerging market countries give benefit to the investor, especially investor from Indonesia, Malaysia, Thailand and Philippines. The result shows that the optimum portfolio of Southeast Asia emerging market countries generate the highest Sharpe Ratio, thus diversification in Southeast Asia emerging market countries give benefit to investors from Indonesia, Malaysia, Thailand and Philippines