

Implementasi algoritma e-new local search based multiobjective optimization dalam optimisasi portofolio saham = Implementation of e-new local search based multiobjective optimization algorithm in stocks portfolio optimization

Rizki Ramadhiani, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20474324&lokasi=lokal>

Abstrak

Permasalahan optimisasi portofolio merupakan topik penelitian yang cukup banyak dibahas dalam bidang keuangan. Model yang biasa digunakan dalam permasalahan tersebut adalah model mean variance yang berfokus pada expected return dan risiko tanpa mempertimbangkan kendala yang terdapat dalam masalah sebenarnya. Pada skripsi ini digunakan model optimisasi portofolio yang mempertimbangkan kendala seperti kendala kardinal dan kendala kuantitas atau biasa dikenal dengan model Mean Variance Cardinality Constrained Portofolio Optimization MVCCPO. Pada skripsi ini menggunakan metode e-New Local Search based Multiobjective Optimization Algorithm yang menonjolkan metode local search dan non dominated sorting didalamnya. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa metode e-NSLS cukup baik digunakan dalam permasalahan optimisasi portofolio.

Portfolio optimization problem is common research topic in finance. The model that usually used of this problem is Markowitz mean variance model focus in expected returns and risks, without considering constraints in real life. In this thesis used a more realistic portfolio optimization problem, such as cardinality and quantity constraints, which is called Markowitz mean variance cardinality constrained portfolio optimization problem MVCCPO problem. This thesis used an algorithm which is based on a multiobjective local search schema and non dominated sorting. The result of this is simulation is good enough to use e NSLS in portofolio optimization.