

Optimalisasi investasi melalui aplikasi analisis portofolio

Sjoufjan Awal, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=90305&lokasi=lokal>

Abstrak

Tulisan ini membahas optimalisasi investasi melalui aplikasi analisis portofolio. Dalam melakukan investasi, investor sering melakukan diversifikasi yaitu pengkombinasian berbagai sarana investasi, dalam hal ini investor tersebut membentuk portofolio. Pembentukan portofolio pada dasarnya dimaksudkan untuk mengurangi resiko yang ditanggung investor.

Konsep resiko dijelaskan melalui pengertian keuntungan rata-rata dari keuntungan-keuntungan dengan probabilitas masing-masing dan terjadinya keuntungan yang menyimpang dari harga rata-rata tersebut. Ditunjukkan bahwa investor dihadapkan pada kesukaran dalam menentukan investasi terbaik karena pada umumnya investasi yang memberikan keuntungan yang besar juga mempunyai resiko tinggi. Melalui pembentukan portofolio investor dapat mengurangi resiko namun dengan keuntungan yang lebih kecil. Pilihan yang ada bagi investor ialah mendapatkan suatu portofolio yang optimal yaitu yang memberikan keuntungan maksimal dengan resiko tertentu.

Untuk tujuan tersebut tulisan ini memaparkan teori tingkat keuntungan dan resiko investasi suatu proyek (riil atau finansiil) dan investasi portofolio dan model-model pemilihan portofolio. Kemudian model-model tersebut diaplikasikan untuk mendapatkan portofolio yang optimal dalam dua kasus. Kasus kesatu adalah mengenai proyek finansiil dan yang kedua proyek riil.