

Analisis alternatif investasi portofolio pada dana pensiun Bank Mandiri I

Niken Paramita, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=96678&lokasi=lokal>

Abstrak

Untuk mengetahui apakah suatu portofolio investasi sudah optimal atau belum, maka dilakukan analisis, salah satunya dengan teori portofolio optimal Markowitz.

Mori potfolio optimal Markowitz ini adalah suatu teori portofolio modern yang digunakan untuk menganalisis pembentukan suatu kombinasi proporsi dari beberapa instrumen investasi sehingga dapat membentuk kombinasi portofolio yang optimal.

Dari hasil perhitungan aplikasi teori portofolio optimal Markowitz yang dibantu dengan program lindo, dengan menggunakan data selama periode Januari 2005 sampai dengan periode Juni 2005, maka diperoleh proporsi dari instrumen investasi SBI, deposito, reksadana, saham dan obligasi.

Hasil] perhitungan, kombinasi portofolio yang optimal terdiri dari 35% pada SB1. 0% pada deposito berjangka 1, 3, 6 bulan, 15% pada reksadana, 20% pada saham dan 30% pada obligasi.