

Analisis Pemilihan dan Optimalisasi Kinerja Portofolio Investasi (Studi Kasus PT Asuransi Jiwa XYZ Periode 2017-2020) = Selection Analysis and Optimization of Investment Portfolio Performance (Case Study on PT Asuransi Jiwa XYZ for the Period 2017-2020)

Andi Devi Oktaviani, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920518919&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini membahas mengenai pemilihan dan optimalisasi portofolio investasi yang dimiliki oleh PT Asuransi Jiwa XYZ pada periode 2017-2020. Analisis pemilihan portofolio diukur pada kesesuaian alokasi aset investasi PT Asuransi Jiwa XYZ dengan peraturan yang berlaku dan karakteristik aset penyusun portofolio investasi diukur dengan tingkat pengembalian dan risiko. Optimalisasi portofolio diperoleh dengan membentuk alternatif portofolio efisien dengan menggunakan model Efficient Frontier, kemudian membandingkan alternatif portofolio tersebut dengan rata-rata portofolio historis dengan melakukan evaluasi kinerja menggunakan risk adjusted measure dengan metode Sharpe Ratio, Treynor Ratio, dan Jansen Alpha Measure. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa portofolio rata-rata historis PT Asuransi Jiwa XYZ belum mencapai hasil optimal karena masih terdapat pemilihan alokasi aset yang belum efisien. Oleh karena itu, PT Asuransi Jiwa XYZ dapat mempertimbangkan alternatif portofolio menggunakan model Efficient Frontier untuk memperoleh hasil investasi yang lebih optimal pada periode selanjutnya.

.....This study discusses the selection and optimization of the investment portfolio owned by PT Asuransi Jiwa XYZ for the period 2017-2020. The portfolio selection analysis is measured on the suitability of the investment asset allocation of PT Asuransi Jiwa XYZ with applicable regulations and the characteristics of the assets that make up the investment portfolio are measured by the rate of return and risk. Portfolio optimization is obtained by forming efficient portfolio alternatives using the Efficient Frontier model, then comparing the portfolio alternatives with historical portfolio averages by evaluating performance using risk adjusted measures using the Sharpe Ratio, Treynor Ratio, and Jansen Alpha Measure methods. The results of this study show that the historical average portfolio of PT Asuransi Jiwa XYZ has not achieved optimal results because there are still inefficient selections of asset allocations. Therefore, PT Asuransi Jiwa XYZ can consider alternative portfolios using the Efficient Frontier model to obtain more optimal investment returns in the next period.