

ABSTRAK

Nama : Dimas Prawira (1209701017)
Jurusan : Matematika
Judul : **Optimisasi Portofolio Optimal pada Saham *Jakarta Islamic Index* (JII). (Studi Komparatif : Menggunakan Model Indeks Tunggal, Model *Mean-Variance*, dan *Mean-Absolute Deviation*)**

Pada kasus ini dibahas pembentukan portofolio optimal dengan menggunakan 3 model, yaitu Model *Mean-Variance*, Model Indeks Tunggal, dan Model *Mean-Absolute Deviation*. Untuk menentukan portofolio yang paling optimal pada studi kasus saham *Jakarta Islamic Index* (JII) yang secara acak diambil 15 saham sebagai objek penelitian. Data yang digunakan adalah data sekunder yang berupa data bulanan pada periode Januari 2012 – Desember 2013. Hasil yang diperoleh menunjukkan bahwa Model Indeks Tunggal memberikan portofolio yang paling optimal, yang terdiri dari 4 saham dan memberikan nilai ekspektasi *return* sebesar sebesar 0,1914 atau 19,14% dan tingkat resiko sebesar 0,00021 atau 0,021%.

Kata kunci: *Optimisasi portofolio, Model Mean-Variance, Model Indeks Tunggal, Model Mean-Absolute Deviation, Return, Resiko.*

UIN
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SUNAN GUNUNG DJATI
BANDUNG

ABSTRACT

Name : Dimas Prawira (1209701017)

Department : Mathematics

Title : **Optimization Portfolio in Stocks of Jakarta Islamic Index (JII). (Comparative Study: Using Single Index Model, Mean-Variance and Mean-Absolute Deviation Model).**

This research attempts to construct optimal portfolio using 3 methods, there are Mean-Variance Model, Single Index Model, and Mean-Absolute Deviation Model. In this case, 15 stocks in Jakarta Islamic Index as a object research. The secondary and monthly data for all stocks for period January 2012 to December 2013 have been considered. The result had proven that Single Index Model given the best optimal portfolio, which 4 stocks constructed as a optimal portfolio and its given expected return 0,1914 or 19,14% and value of risk is 0,00021 or 0,021%.

Keyword: *Portfolio optimization, Mean-Variance Model, Single Index Model, Mean-Absolute Deviation Model, Return, Risk.*

The logo of Universitas Islam Negeri (UIN) Sunan Gunung Djati Bandung, featuring a stylized green and blue emblem above the letters 'UIN'.

UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SUNAN GUNUNG DJATI
BANDUNG