

ABSTRAK

ANALISIS PORTOFOLIO INVESTASI DENGAN METODE *MEAN VARIANCE* STUDI KASUS: DANA Pensiun ABC

Kristy Khairunisa
15/387281/PEK/20831

Dalam penelitian ini penulis akan menganalisis *Mean Variance* Portofolio Investasi yang dimiliki Dana Pensiun ABC. Penelitian ini bertujuan menganalisis kinerja Dana Pensiun ABC dalam melakukan diversifikasi portofolio dengan menggunakan pendekatan Markowitz.

Data penelitian adalah data historis atas investasi yang dilakukan oleh Dana Pensiun ABC yang mencakup instrumen deposito, saham, obligasi, dan reksa dana. Rentang waktu yang digunakan dalam penelitian ini mulai dari tahun 2014 hingga tahun 2018.

Hasil penelitian menunjukkan kinerja investasi portofolio Dana Pensiun dalam periode 2014-2018 dan rata-rata selama periode tersebut masih belum optimal. Untuk itu, selanjutnya Dana Pensiun ABC dapat menggunakan pendekatan *efficient frontier* untuk menemukan portofolio yang optimal.

Kata Kunci: Dana Pensiun, Risiko, *Return*, Investasi, Portofolio, Markowitz.

ABSTRACT

**MEAN VARIANCE ANALYSIS ON
INVESTMENT PORTFOLIO
CASE STUDY: PENSION FUND ABC**

**Kristy Khairunisa
15/387281/PEK/20831**

The purpose of this research is to analyze Mean Variance Analysis of Investment Portfolio of Pension Funds ABC. This research aims to analyze the performance of Pension Fund ABC in diversified portfolios using Markowitz approach.

The research data is historical data on investments made by Pension Fund ABC which includes deposits, stocks, bonds, and mutual funds. Time frame of this research is from 2014 to 2018.

The results show the performance of the investment portfolio of the Pension Fund ABC in the period 2014-2018 and the average over that period is still not optimal. Furthermore Pension Fund ABC could use frontier efficient approach to find the optimal portfolio.

Keywords: Pension Fund, Return, Risk, Investment, Portfolio, Markowitz.