

ABSTRAK

Metode *Equally-weighted Risk Contribution* (ERC) merupakan metode yang membangun portofolio dengan memilih bobot portofolio sehingga kontribusi risiko dari masing – masing komponennya sama. Dalam tugas akhir ini akan dibahas bagaimana membentuk portofolio dengan metode *Equally Risk Contribution* (ERC). Portofolio *Equally Risk Contribution* (ERC) ini digunakan sebab memiliki keunggulan, yaitu portofolio yang dihasilkan terdiversifikasi lebih baik dibandingkan dengan portofolio *Mean Variance* (MV) dan *Equally Weight* (EW), sehingga menghindarkan portofolio yang menumpuk pada satu atau beberapa aset saja (tidak menyebar rata).

Hasil akhir dari penerapan metode *Equally Risk Contribution* (ERC), akan dibandingkan kinerjanya dengan portofolio *Mean Variance* (MV) dan *Equally Weight* (EW). Dimana kontribusi resiko yang dihasilkan portofolio ERC lebih baik dibandingkan portofolio EW, dan volatilitas dari portofolio ERC berada diantara volatilitas portofolio MV dan portofolio EW.

Kata kunci : *diversifikasi portofolio, optimasi portofolio, equally weighted risk contribution*