

## ABSTRAK

Diversifikasi adalah salah satu manajemen portofolio untuk meminimalisir kerugian investor. Dimana investor tidak mengalokasikan semua dana investasinya terhadap satu perusahaan/saham tapi membaginya ke beberapa perusahaan/saham. Terdapat banyak sekali metode-metode atau pendekatan yang digunakan untuk diversifikasi. Sebagai contoh adalah pendekatan portofolio *Risk Parity* (RP) dan pendekatan portofolio *Equal weight*.

*Risk Parity* (RP) adalah pendekatan yang cukup terkenal beberapa dekade ini. Karena metode ini mengungguli pendekatan-pendekatan yang lainnya untuk diversifikasi. Sedangkan pendekatan portofolio *Equal Weight* adalah metode yang paling mudah untuk diversifikasi. Dalam TA ini akan dibahas bagaimana mengimplementasikan portofolio *Risk Parity* dengan menyamakan seluruh *total risk contribution* setiap asetnya.

**Kata kunci** :Diversifikasi, *Risk Parity* (RP) portofolio, *Equal Weight* portofolio.