

## **ABSTRAK**

Pembentukan portofolio saham optimal berhubungan dengan penentuan bobot optimal untuk masing-masing saham pada portofolio. Dalam penelitian ini akan dibahas bagaimana mencari bobot optimal yang meminimalkan resiko dan memaksimumkan return dengan mempertimbangkan parameter biaya transaksi dan minimal jumlah transaksi menggunakan algoritma genetika. Hasil akhir dari penelitian Portofolio yang dibentuk dengan biaya transaksi dan jumlah transaksi memiliki kinerja yang lebih baik dibandingkan, portofolio yang tanpa mempertimbangkan kedua parameter tersebut , sehingga parameter biaya transaksi dan minimal jumlah transaksi dapat digunakan pada penelitian selanjutnya.

**Kata kunci :** Portofolio, Algoritma Genetika, fuzzy ,semi-variance,biaya transaksi, jumlah transaksi minimum