Optimasi Portofolio Saham IDX 30 Menggunakan Metode Black Litterman

Budi Nugroho[1], Dr. Deni Saepudin, S.Si,M.Si.[2]

[1,2,]Fakultas Informatika, Universitas Telkom, Bandung
[1]budinugroho@students.telkomuniversity.ac.id, [2]pembimbing1@telkomuniversity.ac.id

---

Abstrak

Dalam tugas akhir ini akan dilakukan optimasi portofolio menggunakan Black-Litterman. Black Litterman adalah metode untuk menangani kesalahan perkiraan portofolio dalam memperhatikan perkiraan return dengan menggabungkan dua sumber informasi yaitu pengembalian dengan informasi netral dan subjektif. Metode Black-Litterman ini digunakan untuk memperbaiki portofolio dengan metode Black-Litterman dengan melihat pendapat dari investor. Metode Black-Litterman ini digunakan di saham IDX 30 untuk mencari nilai optimasi portofolio. Kinerja Black-Litterman ini dilakukan dengan membandingkan metode portofolio indeks IDX 30 untuk mencari nilai return yang terbaik dan resiko yang minimal.

Kata kunci : Portofolio, Optimasi Portofolio, Return, Black-Litterman, investor, portofolio IDX 30