

## **ABSTRAK**

Penyusunan portofolio dilakukan sebagai salah satu strategi untuk mengurangi resiko yang mungkin akan terjadi dengan keuntungan yang didapat sebesar-besarnya pada saat melakukan investasi. Pendekatan model *mixture* merupakan salah satu metode yang digunakan untuk mengetahui besar proporsi *return* pada suatu instrumen. Model ini mampu memodelkan data yang tersusun dari beberapa grup dimana setiap grup merupakan komponen penyusun dan mempunyai proporsi yang berbeda untuk masing-masing komponen. Hasil dari Tugas Akhir ini berupa model *mixture* untuk portofolio saham Bank BCA dan BNI dengan resiko yang didapat dari model tersebut sebesar -0.2498413758.

Kata Kunci : Portofolio, Model *Mixture*, *Return*