

ABSTRAK

Portofolio optimal telah menjadi perhatian utama dalam dunia keuangan, khususnya dalam konteks investasi. Penelitian ini bertujuan untuk mengeksplorasi konsep portofolio optimal dengan menerapkan metode beta, alpha, dan varian, serta mempertimbangkan strategi aktif dan pasif. Latar belakang penelitian ini melibatkan kompleksitas pasar keuangan yang terus berkembang, di mana investor dihadapkan pada tantangan untuk menciptakan portofolio yang dapat memberikan pengembalian yang optimal dengan tingkat risiko yang dapat diterima.

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengidentifikasi dan menganalisis faktor-faktor yang memengaruhi pembentukan portofolio optimal. Metode yang digunakan mencakup pengukuran beta sebagai ukuran risiko sistematis, perhitungan alpha sebagai ukuran kinerja tambahan, dan penggunaan varian untuk mengukur volatilitas portofolio. Strategi aktif dan pasif kemudian diterapkan untuk memahami dampak pilihan strategi terhadap kinerja portofolio.

Temuan penelitian ini menyoroti pentingnya pemahaman terhadap dinamika pasar dan strategi yang efektif untuk mencapai tujuan investasi. Penelitian ini memberikan wawasan mendalam tentang cara menggunakan metode beta, alpha, dan varian secara terintegrasi untuk merancang portofolio optimal dengan strategi yang sesuai dengan preferensi dan tujuan investor.

Kontribusi penelitian ini terletak pada penyampaian kerangka kerja yang komprehensif untuk mengembangkan portofolio optimal, menggabungkan elemen-elemen strategi aktif dan pasif. Hasil penelitian ini dapat memberikan panduan praktis bagi para investor dalam membuat keputusan investasi yang lebih informasional dan dapat meningkatkan kinerja portofolio mereka.

Kata Kunci: saham, portofolio, beta, alpha, varians