

Analisis Mean Variance portofolio investasi : studi kasus pada dana pensiun X = Mean variance analysis on investment portfolio : case study dana pensiun X

Amalia, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20299550&lokasi=lokal>

---

Abstrak

Tesis ini membahas tentang Analisis Mean Variance Portofolio Investasi yang dimiliki Dana Pensiun X periode 2006-2010. Model yang digunakan dalam penelitian ini adalah Mean Variance yang diperkenalkan oleh Markowitz. Dalam analisis ditemukan bahwa selama periode berlangsung, Portofolio Dana Pensiun X belum merupakan portofolio yang efisien dan optimal. Untuk itu, selanjutnya pengurus Dana Pensiun dapat menggunakan Pendekatan efficient Frontier untuk menemukan portofolio yang optimal.

*This thesis focused on Mean Variance Analysis of Investment Portfolio of Pension Funds owned X period 2006-2010. This research applied Mean Variance Model proposed by Markowitz. Based on analysis, It has found that during the period, X Pension Fund's Portfolio has not been an efficient and optimal portfolio. Therefore, in the next period, pension fund can utilize the Frontier efficient approach to find the optimal portfolio.*