

ABSTRAK

FARALITA FAISAL, 3125121984. Perhitungan *Value at Risk* Portofolio Saham Optimal Menggunakan Metode Simulasi Monte Carlo. Skripsi. Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Universitas Negeri Jakarta. 2016.

Investasi portofolio merupakan investasi yang memberikan dampak positif bagi dunia globalisasi terutama pertumbuhan ekonomi. Investasi portofolio saham optimal dapat menarik investor *risk averter* dalam berinvestasi, hal ini disebabkan portofolio saham dibentuk dengan menentukan *expected return* tertentu dan meminimumkan risiko ataupun sebaliknya. Untuk itu perlu diketahui risiko maksimum portofolio saham yang perhitungannya dipengaruhi oleh periode waktu dan selang kepercayaan. Skripsi ini menghitung *Value at Risk* (VaR) menggunakan metode Simulasi Monte Carlo untuk mengetahui risiko maksimum portofolio saham optimal yang dibentuk oleh *Capital Asset Pricing Model* (CAPM) dimana bobot atau proporsi dana dihitung menggunakan *Mean Variance Efficient Portfolio* (MVEP). Hasil dari perhitungan akan ditampilkan VaR dari portofolio saham optimal beserta perubahan risiko *Marginal VaR* dan besar risiko *Component VaR*.

Kata kunci : investasi portofolio, portofolio saham optimal, *Value at Risk*, Simulasi Monte Carlo.