

**ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA
PORTOFOLIO DENGAN STRATEGI *EQUAL WEIGHT*,
MEAN-VARIANCE OPTIMIZATION, DAN *RISK PARITY***

SKRIPSI

**Diajukan untuk melengkapi persyaratan
dalam memperoleh gelar Sarjana S1**



STEVEN ALDIANSYAH

NIM : 2122096

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS BISNIS DAN AKUNTANSI
UNIVERSITAS KATOLIK MUSI CHARITAS
PALEMBANG
2025**

**ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA
PORTOFOLIO DENGAN STRATEGI *EQUAL WEIGHT*,
MEAN-VARIANCE OPTIMIZATION, DAN *RISK PARITY***

SKRIPSI

**Diajukan untuk melengkapi persyaratan
dalam memperoleh gelar Sarjana S1**



STEVEN ALDIANSYAH

NIM : 2122096

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS BISNIS DAN AKUNTANSI
UNIVERSITAS KATOLIK MUSI CHARITAS
PALEMBANG
2025**

SKRIPSI
ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO
DENGAN STRATEGI *EQUAL WEIGHT*, *MEAN-VARIANCE*
OPTIMIZATION*, DAN *RISK PARITY

Disusun oleh:
STEVEN ALDIANSYAH
NIM: 2122096

Telah disetujui oleh:

Dosen Pembimbing



Heriyanto, S.E., M.Sc.

Tanggal 11 Desember 2024

SKRIPSI
ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO
DENGAN STRATEGI *EQUAL WEIGHT, MEAN-VARIANCE*
OPTIMIZATION, DAN RISK PARITY

Dipersiapkan dan disusun oleh:

STEVEN ALDIANSYAH
NIM: 2122096

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
Pada Tanggal, 13 Februari 2025
Dan dinyatakan memenuhi syarat

Susunan Tim Penguji

Nama Lengkap

Ketua : Heriyanto, S.E., M.Sc.

Anggota : Suramaya Suci Kewal, S.E., M.Si.

Anggota : Maria Josephine Tyra, S.E., M.M.

Tanda Tangan

.....
.....
.....

Palembang, 13 Februari 2025
Ketua Program Studi Manajemen
Fakultas Bisnis dan Akuntansi
Universitas Katolik Musi Charitas


Suramaya Suci Kewal, S.E., M.Si.

MOTTO DAN PERSEMBAHAN

**“BE FEARFUL WHEN OTHERS ARE GREEDY AND
BE GREEDY WHEN OTHERS ARE FEARFUL”**

Warren Buffett

**“IF YOU DON’T BELIEVE IT OR DON’T GET IT, I DON’T
HAVE THE TIME TO TRY TO CONVINCING YOU, SORRY”**

Satoshi Nakamoto

Skripsi ini dipersembahkan untuk:

- 1. Tuhan Yang Maha Esa**
- 2. Papa dan Mama**
- 3. Kakak dan Kedua Adikku**
- 4. Diri Sendiri**
- 5. Sahabat, Teman, dan Rekan Seperjuangan**
- 6. Universitas Katolik Musi Charitas**

PERNYATAAN
KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama : Steven Aldiansyah
NIM : 2122096
Program Studi : Manajemen

Menyatakan bahwa skripsi dengan judul: **ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO DENGAN STRATEGI *EQUAL WEIGHT, MEAN-VARIANCE OPTIMIZATION, DAN RISK PARITY*** adalah karya saya.

Skripsi ini adalah karya ilmiah yang bebas dari unsur plagiat. Apabila dikemudian hari terbukti ada unsur plagiat dalam karya ilmiah ini, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar dan ijazah yang telah diberikan oleh Universitas Katolik Musi Charitas.

Demikianlah pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya dan tanpa paksaan dari pihak manapun.

Palembang, 13 Februari 2025

Pemberi pernyataan



Steven Aldiansyah

PERNYATAAN

PERSETUJUAN UNGGAH KARYA TULIS SKRIPSI

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama : Steven Aldiansyah

NIM : 2122096

Judul Skripsi : **ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO DENGAN STRATEGI *EQUAL WEIGHT*, *MEAN-VARIANCE OPTIMIZATION*, DAN *RISK PARITY***

Menyatakan bahwa saya memberikan hak kepada Universitas Katolik Musi Charitas untuk mempublikasikan skripsi saya tanpa meminta izin dari saya selama nama saya tetap tercantum sebagai penulis.

Demikianlah pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya dan tanpa paksaan dari pihak manapun,

Palembang, 13 Februari 2025

Pemberi pernyataan



Steven Aldiansyah