

Abstrak

Implementasi Dempster Shafer dalam pembentukan portofolio Mean Varian menghasilkan nilai performansi saham yang menjadi acuan untuk pemilihan saham kedalam portofolio saham Mean Varian. Nilai performansi saham dihasilkan dari data variansi *return* dan faktor fundamental saham yang dihitung menggunakan aturan kombinasi Dempster Shafer. Saham dengan nilai performansi tertinggi dipilih kedalam portofolio saham Mean Varian. Pada tugas akhir ini, terdapat 10 saham yang dipilih kedalam portofolio saham yaitu BSDE, GGRM, INDF, SGRO, SMGR, SCMA, MNCN, BBCA, HMSP, dan BMTR dengan menghasilkan portofolio *return* sebesar 0,0125. Evaluasi kinerja portofolio diterapkan dengan menggunakan metode *Sharpe Ratio* dengan hasil yang didapat portofolio saham dengan metode Dempster Shafer sebesar 0,2063 dan portofolio saham Mean Varian tanpa Dempster Shafer sebesar 0,0905. Hasil dari tugas akhir ini, portofolio saham Mean Varian dengan metode Dempster Shafer memiliki kinerja portofolio yang lebih baik dibandingkan portofolio saham Mean Varian tanpa metode Dempster Shafer.

Kata kunci : Dempster Shafer, Portofolio Return, Portofolio Mean Varian, Sharpe Ratio