

Abstrak

Para ilmuwan telah menggunakan optimasi portofolio untuk meminimalkan risiko saham. Salah satu metode dalam optimasi portofolio adalah metode Mean-Variance. Mean-Variance mempertimbangkan dua hal yaitu expected return dari data historis dan variance return dari data historis. Tetapi, mengandalkan dua hal ini saja tidak cukup. Maka dari itu, para ilmuwan telah menemukan cara, dimana salah satu cara itu adalah dengan memprediksi dengan data time series. Memprediksi dengan data time series sendiri mempunyai banyak macam, salah satunya adalah dengan memprediksi hasil return saham. Pada tugas akhir ini, optimasi portofolio ini akan mempertimbangkan hasil prediksi return saham dengan metode Long Short Term Memory atau LSTM. Dataset yang akan digunakan adalah dataset dari saham Jakarta Islam Index atau JII yang mempunyai rentang waktu 7 tahun, dari 3 Desember 2013 sampai dengan 3 Desember 2020.

Kata Kunci: Portofolio; Variance; LSTM; Return;