



LAPORAN TUGAS AKHIR

Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Markowitz dengan Simulasi Monte Carlo – GBM pada Saham Sub-Sektor Asuransi di BEI

Yohanes Novandi Kurniawan Lazuardi

17221037

PROGRAM STUDI ILMU AKTUARIA

Jurusan Sains dan Analitika Data

Fakultas Sains dan Teknologi Informasi

Institut Teknologi Kalimantan

Balikpapan, 2026



LAPORAN TUGAS AKHIR SKRIPSI

Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Markowitz dengan Simulasi Monte Carlo – GBM pada Saham Sub-Sektor Asuransi di BEI

Disusun untuk memenuhi salah satu syarat kelulusan
memperoleh Gelar Sarjana Ilmu Aktuaria

Yohanes Novandi Kurniawan Lazuardi
NIM 17221037

Dosen Pembimbing

Eka Krisna Santoso, S.Si., MBA

Indrawan, S.Pd., M.Si.

PROGRAM STUDI ILMU AKTUARIA
Jurusan Sains dan Analitika Data
Fakultas Sains dan Teknologi Informasi
Institut Teknologi Kalimantan
Balikpapan, 2026