

**PEMBENTUKAN PORTOFOLIO SAHAM MENGGUNAKAN
CAPITAL ASSET PRICING MODEL DAN *MEAN VARIANCE*
EFFICIENT PORTFOLIO SERTA PENGUKURAN RISIKO
BERBASIS SIMULASI MONTE CARLO**



SKRIPSI

Disusun Oleh:

MUHAMMAD RIZAL FANANI

24050121130046

DEPARTEMEN STATISTIKA

FAKULTAS SAINS DAN MATEMATIKA

UNIVERSITAS DIPONEGORO

SEMARANG

2025