

ABSTRAK

Perkembangan jumlah investor ritel di pasar modal Indonesia mendorong kebutuhan akan alat bantu analisis portofolio yang tidak hanya menampilkan pergerakan harga, tetapi juga mengukur kinerja dan risiko secara kuantitatif. Penelitian ini bertujuan merancang dan membangun aplikasi web analisis portofolio saham berbasis Streamlit untuk pasar modal Indonesia. Aplikasi dikembangkan dengan Python menggunakan data harga penutupan harian saham dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) yang diunduh melalui Yahoo Finance. Pengguna dapat menentukan kombinasi saham, bobot portofolio, nominal investasi, nilai tingkat bunga bebas risiko dan periode pengamatan. Aplikasi menghitung *return* tahunan, *return* kumulatif, *alpha*, *beta*, *Sharpe Ratio*, *Sortino Ratio*, *Treynor Ratio*, volatilitas tahunan, *maximum drawdown*, *Value at Risk* parametrik dan historis, serta *Conditional Value at Risk*, kemudian menyajikannya dalam *dashboard* interaktif. Sebagai ilustrasi, digunakan portofolio empat saham perbankan, yaitu PT Bank Central Asia Tbk, PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk, PT Bank Mandiri (Persero) Tbk, dan PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk, dengan bobot sama besar pada periode 1 Januari 2023 hingga 31 Desember 2025 dan nominal investasi awal Rp100.000.000. Hasil menunjukkan *return* kumulatif sebesar 8,71% sehingga nilai portofolio meningkat menjadi sekitar Rp108,71 juta, dengan *Sharpe Ratio* sebesar -0,11, *maximum drawdown* sebesar -34,12%, dan VaR 95% sekitar 2,46% menunjukkan bahwa risiko portofolio tetap perlu diperhatikan.

Kata kunci: portofolio saham, kinerja portofolio, risiko portofolio, *Value at risk*, *Streamlit*, pasar modal Indonesia.