

ABSTRAK

Andriyani Dwi Puspitasari. 2022. *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Di Masa Pandemi Covid-19 Pada Saham LQ-45 Tahun 2020-2021 Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal*. Skripsi. Prodi Manajemen. Pembimbing (I) Dr. H. Febriyanto, S.E., M.M. Pembimbing (II) Karnila Ali, B.Bus, M.P.A.

Investasi akan menguntungkan apabila harga saham naik sehingga *return* yang dihasilkan akan semakin besar. Investasi juga tidak terlepas dari risiko. Tujuan dari penelitian ini adalah Untuk mengetahui Saham unggulan yang dapat membentuk portofolio optimal pada saham LQ-45 di Bursa Efek Indonesia. Untuk mengetahui besarnya proporsi data dari masing-masing saham yang membentuk portofolio optimal dalam Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia. Untuk mengetahui tingkat pengembalian yang diharapkan (*expected return*) dan risiko dari portofolio optimal yang terbentuk di Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia. Untuk mengetahui kinerja saham yang membentuk portofolio optimal dalam Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia. Metode penelitian ini menggunakan penelitian kuantitatif. Instrumen dalam penelitian ini adalah lembar observasi terkait dengan saham-saham LQ-45 dari BEI (Bursa Efek Indonesia) Tahun 2020-2021. Lembar dokumentasi memuat saham-saham dan indeks saham serta *close price*. Analisis data dalam penelitian ini menggunakan metode indeks tunggal. Hasil penelitian ini adalah Analisis pembentukan portofolio optimal dengan menggunakan Model Indeks Tunggal mampu menghasilkan 5 kandidat saham sebagai penyusun portofolio optimal dari 40 sampel penelitian yang berasal dari saham indeks LQ-45. Yang termasuk ke dalam 5 kandidat penyusun portofolio optimal yaitu saham ASSI, INKP, TIKM, TBIG, dan INCO. Analisis pembentukan portofolio optimal dengan menggunakan Model Indeks Tunggal untuk *expected return* portofolio yang akan diperoleh oleh investor adalah 2.68% per bulan, dengan risiko sebesar 0.31% per bulan.

Kata Kunci: Saham, return, metode indeks tunggal