

ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL MENGGUNAKAN METODE INDEKS TUNGGAL PADA SAHAM LQ 45

(Pada Bursa Efek Indonesia Periode Februari 2019 – Juli 2021)

Nurul Dewi Ramadani¹, Febriyanto², Ardiansyah Japlani³

Fakultas Ekonomi Bisnis

Email : nuruldewi735@gmail.com

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menerapkan metode Indeks Tunggal dalam pembentukan portofolio optimal saham-saham yang kontinu masuk kategori Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia periode Februari 2019 – Juli 2021. Pemilihan sampel data dilakukan secara *purposive sampling*. Teknik analisis yang digunakan adalah analisis deskriptif kuantitatif. Berdasarkan perhitungan dari 20 sampel saham yang diteliti tersebut diseleksi menggunakan metode Indeks Tunggal sehingga diperoleh 10 saham saham yang dapat membentuk portofolio optimal dengan proporsi masing-masing, yaitu : Unilever Indonesia Tbk (UNVR) sebesar 41.62%, H.M Sampoerna Tbk (HMSP) sebesar 14.80%, XL Axiata Tbk (EXCL) sebesar 9,41%, Astra International Tbk (ASII) sebesar 9,47%, AKR Corporindo Tbk (AKRA) sebesar 7,81%, Bumi Serpong Damai Tbk (BSDE) sebesar 6,30%, Indah Kiat Pulp & Paper Tbk (INKP) sebesar 3,48%, Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk (BBNI) sebesar 4,49%, Bank Tabungan Indonesia (Persero) Tbk (BBTN) sebesar 1,65% , dan PP (Persero) Tbk (PPTP) sebesar 0,98%. Berdasarkan portofolio optimal yang terbentuk maka *return* ekspektasinya adalah sebesar -1.83% . Dan risiko yang harus dihadapi dari hasil investasi pada portofolio tersebut adalah sebesar 1.57%.

Kata Kunci : indeks LQ 45, Metode indeks tunggal, portofolio optimal