

ABSTRAK

Nadisa Aristia Putri. 2023. *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal Dalam Mengambil Keputusan Investasi Pada Saham Sub Sektor Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia*. Skripsi. Program Studi Manajemen, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Muhammadiyah Metro. Pembimbing (1) Karnila Ali, B.BUS., M.PA. (2) Nani Septiana, S.E., M.M.

Investasi merupakan kunci utama dalam mencapai peningkatan pertumbuhan ekonomi yang tercermin dari kemampuan untuk meningkatkan laju pertumbuhan dan juga tingkat pendapatan. Dalam penelitian ini penulis memilih perusahaan perbankan sebagai objek penelitian. Penelitian ini dilakukan dengan metode penelitian deskriptif kuantitatif yang bertujuan untuk mengetahui saham apa saja yang masuk kedalam kandidat portofolio optimal dan juga untuk mengetahui berapa besar proporsi dari masing-masing saham, lalu untuk mengetahui return dan risiko yang akan diterima. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah 47 saham perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2020-2023. Berdasarkan analisis yang telah penulis lakukan dengan menghitung menggunakan rumus pada Ms excel maka hasil dalam penelitian ini yaitu dari 19 sampel saham perusahaan perbankan terdapat 11 saham yang menjadi kandidat portofolio optimal yaitu Bank Raya Indonesia Tbk, Allo Bank Indonesia Tbk, Bank Victoria International Tbk, Bank CIMB Niaga Tbk, Bank Syariah Indonesia Tbk, Bank Panin Dubai Syariah Tbk, Bank Mandiri (Persero) Tbk, Bank Central Asia Tbk, Bank Negara Indonesia Tbk, Bank Maybank Indonesia Tbk, dan Bank Pan Indonesia Tbk. Dari 11 perusahaan tersebut memiliki proporsi setiap saham yang terpilih adalah BNGA tertinggi sebesar 0,2655 (26,5%), lalu BBHI sebesar 0,1412 (14,1%), BRIS sebesar 0,1207 (12,1%), BBKA 0,1102 (11,0%), AGRO sebesar 0,0822 (8,2%), BMRI sebesar 0,0764 (7,6%), PNBS sebesar 0,0583 (5,8%), BVIC sebesar 0,0546 (5,5%), BNII sebesar 0,0466 (4,7%), BBNI sebesar 0,0398 (4,0%), dan PNBK sebesar 0,0045 (0,4%). Dari saham-saham yang membentuk portofolio optimal memiliki return sebesar 0,0475 (4,75%) dan risiko sebesar 0,0603 (6,03%).

Kata Kunci: Portofolio Optimal, Model Indeks Tunggal, IHSG