

SKRIPSI

**ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL
PADA INDEKS LQ-45 DI BURSA EFEK INDONESIA
PERIODE JULI 2018 – JULI 2019**



DIAJUKAN OLEH:

NAMA : EDWARD

NPM : 115160061

**UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT-SYARAT
GUNA MENCAPAI GELAR SARJANA EKONOMI**

PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

JAKARTA

2020

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS TARUMANAGARA
JAKARTA

TANDA PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : Edward
NIM : 115160061
Program Studi : SI Manajemen

Judul Skripsi

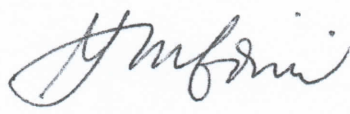
Analisis Pembentukan Portafolio Optimal Pada Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia Periode Juli 2018 - Juli 2019

Telah diuji pada Ujian Skripsi dan Komprehensif tanggal 15 Januari 2020 dan dinyatakan lulus, dengan tim penguji yang terdiri atas:

1. Ketua : Drs., I Gede Adiputra M.M., Dr.
2. Anggota : Nuryasman MN S.E., M.M., Dr.

Jakarta, 30 Januari 2020

Pembimbing


(Dra. Yustardeni, M.E.)

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

FAKULTAS EKONOMI

JAKARTA

ABSTRACT

- (A) EDWARD (115160061)
- (B) *ANALYSIS OPTIMUM PORTFOLIO CONSTRUCTION ON LQ-45 INDEX FROM BURSA EFEK INDONESIA PERIOD JULY 2018 – JULY 2019.*
- (C) *xv + 46 pages, 2020, 9 tables, 1 pictures, 5 attachments.*
- (D) *FINANCIAL MANAGEMENT*
- (E) **Abstract:** *This research topic is ANALYSIS OPTIMUM PORTFOLIO CONSTRUCTION ON LQ-45 INDEX FROM BURSA EFEK INDONESIA PERIOD JULY 2018 – JULY 2019. Investor in the capital market will generally invest in stock that have high return with certain risk. In order to reduce the level of risk then the share can be formed into a portfolio. The purpose of this study was to determine the share of LQ-45 index member to form the optimal portfolio and to determine the proportion of each stock chosen. Population from this research is all of stock who listing on LQ-45 index. The method of this research using Single Index Model. Result of the analysis showed that using Single Index Model approach, stocks member LQ-45 period July 2018 – July 2019 to establish an optimal portfolio is comprised of EXCL 7.33%, ANTM 0.56%, INTP 14.25%, BBRI 30.26%, BBKA 23.80%, BRPT 23.80%. Expected Return from this portfolio is 3.45% per month with risk 3.8%. Conclusion of this research that rational investor will investment in this optimum portfolio.*
- (F) *Keywords: : Optimum Portfolio, Single Index Model, Expected Return, Risk*
- (G) *28 reference*
- (H) *Dra. Yusbardini, M.E.*

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

FAKULTAS EKONOMI

JAKARTA

ABSTRAK

- (A) EDWARD (115160061)
- (B) ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL PADA INDEKS LQ-45 DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE JULI 2018 - JULI 2019
- (C) xv + 46 halaman, 2020, 9 tabel, 1 gambar, 5 lampiran
- (D) MANAJEMEN KEUANGAN
- (E) **Abstrak:** Penelitian ini berjudul **ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL PADA INDEKS LQ-45 DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE JULI 2018 – JULI 2019**. Investor pada pasar modal umumnya akan menginvestasikan dananya pada saham-saham yang memiliki return tinggi dengan risiko tertentu. Untuk mengurangi tingkat risiko maka saham-saham tersebut dapat dibentuk menjadi portofolio. Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui saham-saham dari Indeks LQ-45 yang dapat membentuk portofolio optimal dan mengetahui proporsi masing-masing saham yang terpilih. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh saham yang terdaftar di Indeks LQ-45. Metode yang digunakan adalah menggunakan pendekatan *Single Index Model*, saham-saham pada indeks LQ-45 periode Juli 2018 – Juli 2019 yang dapat membentuk portofolio optimal terdiri dari EXCL 7.33%, ANTM 0.56%, INTP 14.25%, BBRI 30.26%, BBKA 23.80%, BRPT 23.80%. Besarnya nilai *Expected Return* portofolio adalah 3.45% per bulan dengan risiko 3.8%. Kesimpulan dari penelitian ini adalah investor rasional akan menginvestasikan dananya pada portofolio optimal ini.
- (F) Kata kunci: Portofolio Optimal, *Single Index Model*, *Expected Return*, Risiko
- (G) 28 Daftar Acuan
- (H) Dra. Yusbardini, M.E.