

**ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL DENGAN
MODEL INDEKS TUNGGAL PADA SAHAM IDX30 PERIODE 2022-2024
DI BURSA EFEK INDONESIA**

Oleh

Kadek Yuda Saputra, NIM 2117041136

Jurusan Manajemen

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan pada saham IDX30 yang bertujuan menganalisis saham yang masuk ke dalam portofolio optimal, alokasi dana pada saham pembentuk portofolio optimal, dan mengetahui manfaat dari penyusunan portofolio optimal. Populasi yang digunakan adalah saham yang konsisten masuk ke dalam IDX30 selama periode penelitian. Data diperoleh melalui saham yang masuk IDX30, harga penutupan saham, Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), Sertifikat Bank Indonesia (SBI). Berdasarkan hasil analisis data, terdapat 8 (delapan) saham pembentuk portofolio optimal, yaitu Bank Mandiri (Persero) Tbk. (BMRI), Bank Central Asia Tbk. (BBCA), Adaro Energi Indonesia Tbk. (ADRO), Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk. (BNNI), Indo Tambang Raya Megah Tbk. (ITMG), Barito Pacific Tbk. (BRPT), Indofood Sukses Makmur Tbk. (INDF), dan Perusahaan Gas Negara Tbk. (PGAS). Penelitian ini memberikan hasil yaitu portofolio optimal dapat dijadikan pedoman untuk menentukan alokasi dana dan juga dapat menekan risiko investasi dan meningkatkan pengembalian ekspektasi.

Kata Kunci: IDX30, investasi, model indeks tunggal, portofolio optimal

***THE ANALYSIS OF OPTIMUM PORTFOLIO FORMATION
USING SINGLE INDEX MODEL IN IDX30 PERIOD 2022-2024
IN INDONESIA STOCK EXCHANGE***

By

Kadek Yuda Saputra, NIM 2117041136

Management Departement

ABSTRAK

This study was conducted on IDX30 stocks with the aim of analyzing stocks included in the optimal portfolio, fund allocation to stocks forming the optimal portfolio, and knowing the benefits of compiling the optimal portfolio. The population used is stocks that consistently enter the IDX30 during the research period. Data is obtained through stocks included in the IDX30, stock closing prices, the Composite Stock Price Index (IHSG), Bank Indonesia Certificates (SBI). Based on the results of data analysis, there are 8 (eight) stocks forming the optimal portfolio, namely Bank Mandiri (Persero) Tbk. (BMRI), Bank Central Asia Tbk. (BBCA), Adaro Energi Indonesia Tbk. (ADRO), Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk. (BNNI), Indo Tambang Raya Megah Tbk. (ITMG), Barito Pacific Tbk. (BRPT), Indofood Sukses Makmur Tbk. (INDF), and Perusahaan Gas Negara Tbk. (PGAS). This study provides results that the optimal portfolio can be used as a guideline for determining fund allocation and can also reduce investment risk and increase expected returns.

Keywords: IDX30, investment, optimum portfolio, single index model

