

Nama : Josefanny Clarita Ndun
NIM : 3012211027
Judul Tugas Akhir : ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL
DENGAN MENGGUNAKAN MODEL MARKOWITZ
PADA SAHAM INDEKS KOMPAS100 PERIODE
FEBRUARI 2024-JANUARI 2025

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk membentuk portofolio optimal saham, terutama saham yang tergabung dalam indeks KOMPAS100 dengan menggunakan Metode Markowitz.

Metodologi penelitian yang digunakan adalah metode kualitatif dengan menggunakan data sekunder yang diperoleh melalui website resmi Bursa Efek Indonesia dan investing.com. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode purposive sampling. Objek penelitiannya adalah saham indeks KOMPAS100 periode efektif Februari 2024 – Januari 2025. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis portofolio menggunakan model Markowitz.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa ada tiga belas saham yang masuk ke dalam portofolio optimal dari delapan puluh lima saham yang diteliti, proporsi masing-masing saham yang membentuk portofolio optimal yaitu MAPA (17,30%), PGAS (15,52%), TBIG (13,13%), SIDO (12,51%), HEAL (10,37%), EMTK (7,51%), DSNG (6,39%), PTRO (6,13%), SSMS (4,68%), DOID (3,13%), JPFA (2,38%), BRMS (0,95%) dan SMIL (0,01%). Portofolio optimal tersebut diharapkan dapat menghasilkan return bulanan sebesar 2,78% dan risiko bulanan yang harus dihadapi oleh investor atas investasinya sebesar 0,85%.

Kata kunci : Portfolio Optimal, Model Markowitz, KOMPAS100, Return, Risiko

Penulis



Josefanny Clarita Ndun
3012211027

Name : Josefanny Clarita Ndun
NIM : 3012211027
Thesis Title : THE ANALYSIS OF OPTIMAL PORTOFOLIO
FORMATION USING MARKOWITZ MODEL OF
KOMPAS100 INDEX STOCK FOR THE PERIODS
FEBRUARY 2024-JANUARY 2025

ABSTRACT

The study aims to form an optimal portfolio of stock, especially stock that are incorporated the KOMPAS100 index using the Markowitz method.

The research methodology used is a qualitative method using secondary data obtained through the official website of the Indonesia Stock Exchange and investing.com. The sampling technique used the purposive sampling method. The objects of research is KOMPAS100 stocks for the effective period February 2024-January 2025. The data analysis technique used is portfolio analysis using the Markowitz model.

The results of this study indicate that there are thirteen stocks that are included in the optimal portfolio of the eighty-five stocks studied, the proportion of each stock that makes up the optimal portfolio are MAPA (17,30%), PGAS (15,52%), TBIG (13,13%), SIDO (12,51%), HEAL (10,37%), EMTK (7,51%), DSNG (6,39%), PTRO (6,13%), SSMS (4,68%), DOID (3,13%), JPFA (2,38%), BRMS (0,95%) and SMIL (0,01%). The optimal portfolio is expected to generate a monthly return of 2,78% and a monthly risk that must be faced by investors for their investment of 0,85%.

Keywords: Optimal Portfolio, Markowitz Model, KOMPAS100, Return, Risk

Author



Josefanny Clarita Ndun
3012211027