

Nama : Dhila Puspita Nugraha
NIM : 3012201115
Judul Tugas Akhir : ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO
OPTIMAL DENGAN MENGGUNAKAN MODEL
MARKOWITZ PADA SAHAM INDEKS
KOMPAS100 PERIODE FEBRUARI 2023-
JANUARI 2024

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 yahoo finance. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode purposive sampling. Objek penelitiannya adalah saham indeks KOMPAS100 periode efektif Februari 2023 – Januari 2024. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis portofolio menggunakan model Markowitz.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa ada sembilan saham yang masuk ke dalam portofolio optimal dari delapan puluh delapan saham yang diteliti, proporsi masing-masing saham yang membentuk portofolio optimal yaitu TLKM (26,893%), CTRA (26,545%), ELSA (19,496%), JSMR (8,724%), INKP (5,136%), AKRA (4,819%), ACES (3,798%), RAJA (3,420%), dan BRPT (1,168%). Portofolio optimal tersebut diharapkan dapat menghasilkan return bulanan sebesar 2,070% dan risiko bulanan yang harus dihadapi oleh investor atas investasinya sebesar 0,851%.

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

Penulis



Dhila Puspita Nugraha
3012201115

Name : Dhila Puspita Nugraha
NIM : 3012201115
Title : THE ANALYSIS OF OPTIMAL PORTFOLIO
FORMATION USING MARKOWITZ MODEL OF
KOMPAS100 INDEX STOCK FOR THE PERIODS
FEBRUARY 2023-JANUARI 2024

ABSTRACT

The study aims to form an optimal portfolio of stock, especially stocks 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 yahoo finance. The sampling technique used the purposive sampling method. The objects of research is KOMPAS100 stocks for the effective period February 2023-January 2024. The data analysis technique used is portfolio analysis using the Markowitz model.

The results of this study indicate that there are nine stocks that are included in the optimal portfolio of the eighty-eight stocks studied, the proportion of each stock that makes up the optimal portfolio are TLKM (26,893%), CTRA (26,545%), ELSA (19,496%), JSMR (8,724%), INKP (5,136%), AKRA (4,819%), ACES (3,798%), RAJA (3,420%), and BRPT (1,168%). The optimal portfolio is expected to generate a monthly return of 2,070% and a monthly risk that must be faced by investors for their investment of 0,851%.

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

Author



Dhila Puspita Nugraha
3012201115