

Analisa portfolio optimal saham : studi kasus di bursa efek Jakarta

Andrianus Koosherlan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20184382&lokasi=lokal>

Abstrak

Pasar modal merupakan alternatif baru pembiayaan pembangunan yang mencakup segi-segi idealisme Pancasila.

Tetapi investasi dalam bentuk kepemilikan saham di pasar modal mengandung resiko yang besar karena kondisi ketidakpastian. Untuk itu perlu dilakukan diversifikasi investasi dalam bentuk portofolio optimal saham. Data penelitian diperoleh dari Bursa Efek Jakarta, BAPEPAM dan studi kepustakaan. Portofolio optimal saham ditentukan melalui Single Index Model dan Mean Variance Model. Hasil penelitian menunjukkan bahwa portofolio optimal saham dapat mengurangi resiko investasi dalam bentuk kepemilikan saham. Jadi portofolio optimal saham dapat meminimalisir resiko karena fluktuasi yang terjadi di pasar modal akibat systematic dan unsystematic risk.