

Analisis portofolio optimal dengan metode markowitz metode graham dan single index model studi kasus pada saham indeks lq45 dan saham indeks bisnis 27 di bursa efek indonesia = Optimal portfolio analysis using markowitz method graham and single index model case study at lq45 stock index and bisnis 27 stock index in the indonesia stock exchange

Muslikhin B. Ridwan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20365507&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui saham-saham yang tergabung dalam Indeks LQ45 dan Indeks Bisnis 27 di Bursa Efek Indonesia yang memenuhi kriteria penyeleksian saham sesuai dengan metode Markowitz, metode seleksi Graham dan metode single indeks. Dari hasil seleksi tersebut dilakukan pembentukan portofolio optimal dan evaluasi kinerja portofolio agar memastikan bahwa komposisi portofolio yang terbentuk mampu menghasilkan return yang setinggi-tingginya bagi investor. Hasil penelitian ini menyarankan bahwa hasil portofolio yang di bentuk dengan kriteria average return tertinggi metode Markowitz dan portofolio yang dibentuk dengan metode Single Index Model dengan sampel saham-saham Bisnis 27. Memiliki return portofolio yang lebih besar dan kinerja lebih baik dibandingkan dengan portofolio optimal yang dibentuk dengan menggunakan seleksi berdasarkan kriteria investor aktif Graham dan kriteria investor defensif Graham.

ABSTRACT

This research aims to identify stocks in the LQ45 and Bisnis 27 indexes at Indonesia Stock Exchange that meet criteria for stocks to be selected according to Markowitz, Graham, and Single Index methods. The results show that the optimal portfolio composition generates high returns. The results also suggest that portfolio which is formed by Bisnis 27 Stock, using Markowitz model gives highest average return and portofolio which is formed by Bisnis 27 Stock, using Single Index Model, has a better portfolio performance as compared to the optimal portfolio which is formed using the Graham defensive and active investor criteria.