

Analisis Komparatif Pembentukan Portofolio Optimal Antara Saham-Saham Papan Utama dan Saham-Saham Papan Pengembangan Menggunakan Single Index Model: Analisis Periode Tahun 2018-2019 (Sebelum Krisis) Dan Tahun 2020-2021 (Selama Krisis) = The Comparison of Optimal Portfolio Formation Analysis with Single Index Model : Analysis of The Period Before and During Crisis

Uska Wyanov, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920528601&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini berfokus pada analisis perbandingan portofolio yang dilakukan antara 30 saham papan utama dan 30 saham papan pengembangan yang terpilih dari Bursa Efek Indonesia (BEI). Analisis yang digunakan pada penelitian ini adalah single index model. Periode yang digunakan pada penelitian ini adalah 2018-2019 (sebelum krisis) dan 2020-2021 (selama krisis).

Hasil penelitian berhasil menyimpulkan bahwa kelompok saham Papan Pengembangan menghasilkan return portofolio yang lebih tinggi dibandingkan dengan kelompok saham Papan Utama, baik di periode 2018-2019 (sebelum krisis) dan di periode 2020-2021 (selama krisis). Namun, meskipun menghasilkan return portofolio yang lebih tinggi, kelompok saham Papan Pengembangan juga memiliki tingkat risiko portofolio yang lebih tinggi dibandingkan dengan kelompok saham Papan Utama.

.....This paper focuses on a portfolio comparison analysis between 30 leading board stocks and 30 development board stocks selected from the Indonesia Stock Exchange (IDX). The analysis used in this study is the single index model. The periods used in this study are 2018-2019 (before the crisis) and 2020-2021 (during the crisis).

The research results concluded that the Development Board stock group generated a higher portfolio return compared to the Main Board stock group, both in the 2018-2019 period (before the crisis) and in the 2020-2021 period (during the crisis). However, even though it produces a higher portfolio return, the Development Board stock group also has a higher level of portfolio risk compared to the Main Board stock group.