

SUMMARY

ANALISIS PERBANDINGAN PEMBENTUKAN PORTOFOLIO DENGAN MENGGUNAKAN MODEL MARKOWITZ DAN SINGLE INDEX MODEL PADA SAHAM YANG MASUK DALAM INDEX LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2009 – 2013

Created by Bob Kertopati

Subject : ANALISIS PERBANDINGAN PEMBENTUKAN PORTOFOLIO DENGAN MENGGUNAKAN MODEL MARKOWITZ DAN SINGLE INDEX MODEL PADA SAHAM YANG MASUK DALAM INDEX LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2009 – 2013

Subject Alt : ANALISIS PERBANDINGAN PEMBENTUKAN PORTOFOLIO DENGAN MENGGUNAKAN MODEL MARKOWITZ DAN SINGLE INDEX MODEL PADA SAHAM YANG MASUK DALAM INDEX LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2009 – 2013

Keyword : PERBANDINGAN PEMBENTUKAN PORTOFOLIO

Description :

Analisis Perbandingan Pembentukan Portofolio dengan Menggunakan Model Markowitz dan Single Index Model pada Saham yang Masuk Dalam Index LQ45 Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2009 – 2013 (dibimbing oleh Drs. Dihin Septyanto)

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk memberikan acuan dan rekomendasi kepada investor atau calon investor pasar modal, khususnya saham dengan cara menentukan saham-saham yang dapat dijadikan portofolio yang efisien dengan perhitungan Markowitz dan juga Single Index Model. Selain itu, penelitian ini juga dimaksudkan untuk menunjukkan model perhitungan yang paling efisien yang dapat digunakan oleh investor atau calon investor untuk menentukan saham pembentuk portofolio. Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan Saham-saham yang masuk kedalam Indeks LQ45 periode 2009 hingga 2013.

Setelah melakukan penelitian, didapat 7 saham pembentuk portofolio optimal yang didapat dari perhitungan Markowitz. Saham-saham tersebut adalah BBKA dengan proporsi dana 12%, BBNI dengan proporsi dana 17%, BMRI dengan proporsi dana 14%, INDF dengan proporsi dana 19%, ITMG dengan proporsi dana 12%, SMGR dengan proporsi dana 13%, dan UNTR dengan proporsi dana 13%. Return yang didapat dari portofolio tersebut sebesar 3,008% dan resiko sebesar 0,467%. Sedangkan dengan perhitungan Single Index Model, didapat 11 saham pembentuk portofolio optimal yaitu AALI dengan proporsi dana 10%, BBKA dengan proporsi dana 16%, BBNI dengan proporsi dana 8%, BDMN dengan proporsi dana 1%, BMRI dengan proporsi dana 10%, INDF dengan proporsi dana 18%, ITMG dengan proporsi dana 5%, LSIP dengan proporsi dana 1%, PGAS dengan proporsi dana 4%, SMGR dengan proporsi dana 17%, dan UNTR dengan proporsi dana 10%, menghasilkan Return sebesar 2,753%, Expected Return sebesar 0,596%, dan Resiko sebesar 0,0264%. Portofolio yang paling efisien adalah portofolio yang dibentuk menggunakan perhitungan Markowitz karena return yang dihasilkan lebih besar dibandingkan dengan return yang dihasilkan oleh perhitungan Single Index Model.

Date Create : 22/11/2014

Type : Text
Format : PDF
Language : Indonesian
Identifier : UEU-Undergraduate-undergraduate_2010-11-209
Collection : undergraduate_2010-11-209
Source : Undergraduate these economy of faculty
Relation Collection Universitas Esa Unggul
COverage : Civitas Akademika Universitas Esa Unggul
Right : copyright2014@esaunggul

Full file - Member Only

If You want to view FullText...Please Register as MEMBER

Contact Person :

Astrid Chrisafi (mutiaraadinda@yahoo.com)

Thank You,

Astrid (astrid.chrisafi@esaunggul.ac.id)

Supervisor