

# ANALISIS PORTOFOLIO OPTIMAL DENGAN MENGGUNAKAN METODE INDEKS TUNGGAL UNTUK PENGAMBILAN KEPUTUSAN INVESTASI DI INDONESIA

## ABSTRAK

Banyaknya jumlah perusahaan yang listing di BEI, membuat para investor bingung untuk menentukan pilihan yang tepat, saham mana yang aman, terbaik dan layak untuk dibeli. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis saham unggulan yang dapat di masukkan ke dalam kandidat perhitungan portifolio optimal di Indonesia serta menganalisis nilai proporsi dan dana investasi pada masing – masing saham yang dapat di masukkan ke dalam kandidat perhitungan portifolio optimal di Indonesia.

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah seluruh saham perusahaan go public yang terdaftar dalam kelompok saham LQ-45 di BEI. Teknik pengambilan sampel dalam penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, sehingga jumlah sampelnya 45 perusahaan LQ45 periode Februari 2019- Juli 2019. Teknik yang di gunakan untuk menganalisis data untuk membentuk portofolio optimal adalah dengan menggunakan model indeks tunggal.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa saham unggulan yang dapat di masukkan ke dalam kandidat perhitungan portifolio optimal di Indonesia adalah saham GGRP, SRIL dan HMSP. Besar proporsi dana untuk investasi pada masing– masing saham unggulan yang dapat di masukkan ke dalam kandidat perhitungan portifolio optimal di Indonesia yaitu saham GGRM sebesar 0,43 atau 43%, saham SRIL sebesar 0,34 atau 34% dan saham HMSP sebesar 0,24 atau 24%.

Kata kunci: Model Indeks Tunggal, Portofolio Optimal, LQ-45..