

**PENERAPAN *MODEL INDEKS TUNGGAL*
DALAM PEMBENTUKAN PORTOFOLIO
OPTIMAL SAHAM**

Siti Aisyah
NIM: 4161230026

ABSTRAK

Investasi saham pada pasar modal adalah investasi yang memiliki risiko besar maka jika tidak berhati-hati dalam memilih saham dapat memungkinkan terjadinya kerugian. Dalam hal ini investor perlu membentuk portofolio optimal saham untuk mengurangi risiko dalam kegiatan investasi dipasar modal. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui nilai portofolio optimal saham pada masa pandemi covid-19 menggunakan model indeks tunggal. Data yang digunakan merupakan data harga saham, IHSG dan BI *Rate* yaitu pada januari sampai desember 2020. Berdasarkan penelitian yang telah dilakukan diperoleh 6 saham yang tergolong kedalam portofolio optimal saham selama pandemi 2020. Besarnya nilai proporsi masing-masing saham adalah saham COCO sebesar 0.84%, saham GOOD sebesar 59%, saham ROTI sebesar 35%, saham SKBM sebesar 0.78%, saham ULTJ sebesar 1.4%, dan saham UNVR sebesar 3%, dengan nilai ekspekstasi *return* portofolio adalah 0.39% dan risikonya 0.0066%.

Kata Kunci : Portofolio Optimal Saham, Saham Industri Barang Konsumsi, Model Indeks Tunggal.

THE
Character Building
UNIVERSITY