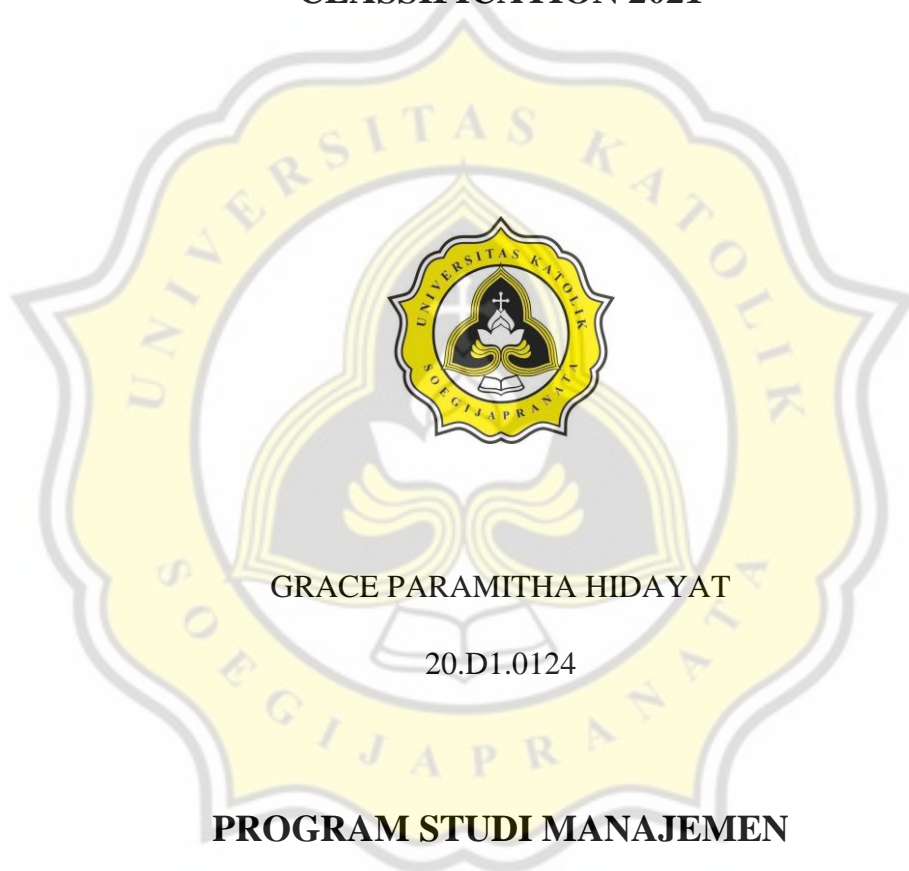


LAPORAN SKRIPSI

**PORTOFOLIO OPTIMAL MODEL INDEKS TUNGGAL
SAHAM-SAHAM SUB SEKTOR FOOD & BEVERAGE DI
BURSA EFEK INDONESIA PASCA IDX-INDUSTRIAL
CLASSIFICATION 2021**



GRACE PARAMITHA HIDAYAT

20.D1.0124

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA

SEMARANG

2024

LAPORAN SKRIPSI

**PORTOFOLIO OPTIMAL MODEL INDEKS TUNGGAL
SAHAM-SAHAM SUB SEKTOR FOOD & BEVERAGE DI
BURSA EFEK INDONESIA PASCA IDX-INDUSTRIAL
CLASSIFICATION 2021**

Diajukan untuk memenuhi syarat guna mencapai gelar Sarjana pada Program
Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Katolik

Soegijapranata



GRACE PARAMITHA HIDAYAT

20.D1.0124

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA
SEMARANG**

2024

ABSTRAK

Sejak 25 Januari 2021, BEI menerapkan klasifikasi industry baru yaitu menggantikan JASICA dengan IDX-IC. Pada portofolio optimal dan kinerja portofolio adalah model perhitungan yang digunakan untuk memperhitungkan tingkat pengembalian yang diharapkan dari investasi. Penelitian ini adalah penelitian deskriptif dengan analisis kuantitatif, tujuannya untuk mengetahui dari kinerja saham-saham yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2020-2022 berdasarkan tingkat dari pengembalian dan risiko yang masuk kedalam portofolio optimal. Populasi pada penelitian ini diambil dari tahun 2021 dengan tiga triwulan, yaitu triwulan satu berjumlah 33 emiten, triwulan dua berjumlah 64 emiten, dan triwulan empat berjumlah 72 emiten yang berdasarkan teknik sensus. Hasil penelitian ini menunjukkan pada triwulan satu dari 33 sampel menjadi 11 emiten yang terseleksi, triwulan dua dari 64 emiten ada saham yang dikeluarkan karena *delisted* sehingga menjadi 63 sampel menjadi 21 emiten yang terseleksi, dan triwulan empat dari 72 sampel menjadi 14 emiten yang terseleksi masuk kedalam pembentuk portofolio optimal. Setelah membentuk portofolio optimal dengan mengikuti model indeks tunggal, selanjutnya adalah penilaian dari kinerja portofolio pada periode memegang portofolio saham selama satu, dua, dan tiga bulan. Hasil dari kinerja portofolio adalah dua bulan adalah yang terendah dan tiga bulan adalah yang tertinggi. Implikasi dari penelitian ini adalah dari hasil portofolio optimal tidak *proposional* karena, hanya mendapatkan portofolio yang beranggotakan 11 menjadi 21 ke 12, sehingga pada kinerja portofolio adalah keputusan investasi untuk menahan selama tiga bulan yang dikarenakan, memiliki tingkat *return* yang maksimal dan risiko yang minimal.

Kata Kunci: Model Indeks Tunggal, Portofolio Optimal, Kinerja Portofolio