

ABSTRAK

Yolanda Erivo, 2014/14059024. Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Model Indeks Tunggal Untuk Pengambilan Keputusan Investasi Di BEI Pada Saham LQ-45

**Pembimbing : 1. Dina Patrisia, SE, M.Si, Ak, Ph.D.
2. Megawati, SE, MM.**

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menganalisis portofolio optimal dengan metode *single indeks model* untuk keputusan investasi di BEI pada saham LQ-45. Penelitian ini merupakan penelitian deskriptif komparatif. Populasi dalam penelitian ini adalah saham-saham yang secara kontinu masuk kedalam LQ-45 dari Agustus 2012 sampai dengan Juli 2017. Teknik pemilihan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan data sekunder yang dipublikasikan melalui *Yahoo Finance* dan *BI*. Diperoleh jumlah sampel sebanyak 21 saham perusahaan dari 76 saham perusahaan. Metode analisis yang digunakan adalah Analisis Portofolio optimal metode *single index model* dengan Excel dan Uji T *independent sampel t test* dengan SPSS. Hasil penelitian ini menyimpulkan (1) terdapat 7 saham yang masuk kedalam kandidat portofolio yaitu beserta proporsi adalah ICBP (28,8%), AKRA (16,5%), BBCA (29,3%), UNVR (15,3%), BBRI (6,4%), ADRO (1,7%), dan BBNI (2%) (2) Terdapat perbedaan tingkat *return* antara kandidat portofolio dengan non kandidat portofolio (3) Tidak terdapat perbedaan tingkat risiko antara kandidat portofolio dengan non kandidat portofolio (4) Tidak terdapat perbedaan rata-rata volume perdagangan antara kandidat portofolio dengan non kandidat portofolio.

Kata Kunci: *Portofolio Optimal, Single Indeks Model, dan LQ-45*