



**JURUSAN AKUNTANSI
FAKULTAS EKONOMI**



Dosen Pembimbing : Dr. Yulia Hendri Yeni, SE, MT, Ak, CA

*Diajukan untuk Memenuhi Sebagian dari Syarat-syarat Guna Memperoleh
Gelar Sarjana Ekonomi*

PADANG

2019



No Alumni
Universitas:

Mutia Refika Dewi

No Alumni Fakultas:

BIODATA :

a) Tempat/Tgl Lahir: Padang, 08 Januari 1995 b) Nama Orang Tua: Masrul dan Jaslaini c) Fakultas: Ekonomi d) Jurusan: Akuntansi e) No. BP: 1610536035 f) Tanggal Lulus: 22 April 2019 g) Predikat lulus: Sangat Memuaskan h) IPK: 3,29 i) Lama Studi: 2 Tahun 8 bulan j) Alamat Orang Tua: Perumnas Blok B5 No.16 Painan, Pesisir Selatan

PENENTUAN PORTOFOLIO SAHAM OPTIMAL DENGAN METODE SINGLE INDEX SEBAGAI DASAR PENETAPAN INVESTASI SAHAM (STUDI EMPIRIS PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2013-2017)

Skripsi Oleh Mutia Refika Dewi
Pembimbing Dr. Yulia Hendri Yeni, SE, MT, Ak, CA

ABSTRACT

This study aims to determine the optimal stock portfolio as a basis for determining investment in shares of manufacturing companies listed on the Indonesia Stock Exchange. The research period used was 2013-2017. This research is descriptive quantitative research. The study population was 143 manufacturing companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period 2013-2017. Sample selection was determined by purposive sampling technique with the criteria of active shares based on trading volume and dividend distribution in a row conducted by the company during 2013-2016, so as to obtain a sample of nineteen shares. The method used in this study is a single index model.

The results showed that there were ten stocks that were portfolio candidates namely ASII with a proportion of funds of 8.771%, EKAD with a proportion of funds of 18.240%, GGRM with a proportion of funds of 14.158%, INDF with a proportion of funds of 10.536%, INTP with a proportion of funds 4.502%, KAEF with a proportion of funds 6.202%, ROTI with a proportion of funds of 4.796%, SMSM with a proportion of funds of 18.699%, TKIM with a proportion of funds of 9,490%, and KBLM with a proportion of funds of 4,605%. The ten shares produced an expected return of 1.4565% and the risk borne by investors was 0.000045%.

Keywords: *stock portfolio, single index, portfolio candidates, returns, and risks.*

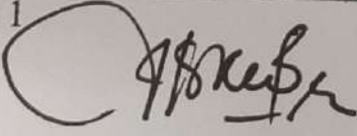
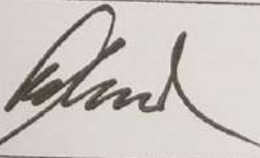
ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menentukan portofolio saham optimal sebagai dasar penetapan investasi pada saham perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Periode penelitian yang digunakan adalah tahun 2013-2017. Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif deskriptif. Populasi penelitian adalah 143 perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017. Pemilihan sampel ditentukan dengan teknik *purposive sampling* dengan kriteria saham yang aktif berdasarkan volume perdagangan dan pembagian dividen secara berturut-turut yang dilakukan perusahaan selama tahun 2013-2016, sehingga diperoleh sampel sebanyak sembilan belas saham. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah model *single index*.

Hasil penelitian menunjukkan terdapat sepuluh saham yang menjadi kandidat portofolio yaitu ASII dengan proporsi dana 8,771%, EKAD dengan proporsi dana 18,240%, GGRM dengan proporsi dana 14,158%, INDF dengan proporsi dana 10,536%, INTP dengan proporsi dana 4,502%, KAEF dengan proporsi dana 6,202%, ROTI dengan proporsi dana 4,796%, SMSM dengan proporsi dana 18,699%, TKIM dengan proporsi dana 9,490%, dan KBLM dengan proporsi dana 4,605%. Sepuluh saham tersebut menghasilkan *expected return* sebesar 1,4565% dan risiko yang ditanggung investor sebesar 0,000045%.

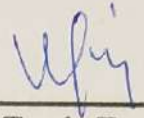
Kata kunci: *portofolio saham, single index, kandidat portofolio, return, dan risiko*

Skripsi ini telah dipertahankan di depan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada tanggal 22 April 2019, dengan penguji:

TandaTangan	1 	2 
NamaTerang	Dra. Sri Dewi Edmawati, M.Si, Ak, CA	Drs. Amsal Djunid, M.Bus, Ak, CA

Mengetahui:

Ketua Program Studi Intake Akuntansi: **Dra. Warnida, SE., MM., Ak, CA**
NIP. 19651118 199203 2 003



Tanda Tangan

Alumnus telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan mendapat nomor alumnus:

	Petugas Fakultas/Universitas	
No. Alumni Fakultas	Nama:	Tanda Tangan
No. Alumni Universitas	Nama:	Tanda Tangan