

INTISARI

Tujuan penelitian ini untuk mendiskripsikan dan menganalisis portofolio optimal dengan menggunakan model Indeks Tunggal sebagai bahan masukan untuk keputusan investasi pada perusahaan sektor pertambangan batubara di Bursa Efek Indonesia. Data yang digunakan dalam penelitian yaitu harga saham individu per tahun, pembagian deviden per tahun, pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan suku bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI) pada tahun 2011 sampai 2015. Populasi penelitian ini adalah pada sektor pertambangan batubara yang tercatat di Bursa Efek Indonesia tahun 2015.

Hasil penelitian menunjukkan dari 6 saham perusahaan pertambangan batubara yang dijadikan sampel diperoleh 2 saham yang optimal sehingga di dapatkan 1 kombinasi portofolio yaitu kombinasi saham PT Bayan Resources Tbk. Dan saham PT Resource Alam Indonesia Tbk.

Kata Kunci: Model Indeks Tunggal, Portofolio optimal, Investasi



ABSTRACT

This research is aimed to describe and to analyze the optimal portofolio which ha been carried out single index model as the input to the investment decision on the coal mining sector companies which are listed in Indonesia Stock Exchange. The data has been obtained the individual stock price per year, devidend share per year, the fluctuation of Indonesia Composite Index (IHSG) and the interest rate of Bank Indonesia Certificate (SBI) from 2011 until 2015. The population of this research is all coal mining sector companies which are listed in Indonesia Stock Exchange in 2015.

The result of this research shows that 2 of 6 stocks of coal mining companes have been selected as optimal stocks therefore 1 ccmbined portofolio which is of the combiination of PT Bayan Resources Tbk. Stocks And PT Resource Alam Indonesia Tbk. Stock has been obtained.

Keywords: Single index model, optimal portofolio, investment.

