

ABSTRAK

Noviana Rahmawati, 1620210085, “Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal pada Saham Sektor *Consumer Goods Industry* yang *Listing* di ISSI Periode 2017-2019”.

Penelitian ini merupakan penelitian kepustakaan dengan pendekatan kuantitatif. Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui portofolio optimal yang dapat dibentuk, mengetahui komposisi modal yang harus diinvestasikan, serta mengetahui tingkat *return* dan risiko dari portofolio yang telah dibentuk.

Penelitian ini menggunakan model indeks tunggal untuk membentuk portofolio yang optimal. Model indeks tunggal merupakan suatu model analisis portofolio dimana dalam menentukan saham-saham pembentuk portofolio optimal menggunakan perhitungan nilai ERB dan nilai C_i . Nilai C_i merupakan pembatas nilai ERB berapa yang dikatakan tinggi. Jika ERB lebih besar dari C_i , maka saham tersebut masuk dalam kandidat portofolio optimal.

Populasi penelitian ini adalah 56 perusahaan *Consumer Goods Industry* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2017-2019. Sedangkan sampel penelitian ini adalah 27 perusahaan. Sampel ditentukan dengan teknik *purposive sampling* dengan kriteria, perusahaan *consumer goods industry* yang *listing* di ISSI, dan aktif di perjual belikan selama periode 2017-2019.

Hasil penelitian menunjukkan terdapat 9 saham yang menjadi kandidat portofolio dari 27 saham yang diteliti. Ke-9 saham tersebut adalah saham TCID dengan proporsi 56,6247%, saham MRAT dengan proporsi 8,0924%, saham SIDO dengan proporsi 8,9166%, saham DVLA dengan proporsi 4,4719%, saham KICI dengan proporsi 0,2381%, saham KINO dengan proporsi 0,3179%, saham MYOR dengan proporsi 1,2134%, saham ICBP dengan proporsi 18,96%, dan saham PYFA dengan proporsi 1,1647%. 9 saham tersebut diharapkan mempunyai return sebesar 0,009065 per bulan dan risiko sebesar 0,613526 per bulan.

Kata Kunci : Portofolio Optimal, Model Indeks Tunggal, Return, dan Risiko.