

ABSTRAK

ANALISIS PORTOFOLIO UNTUK MENENTUKAN *RISK AND RETURN* PADA SUB SEKTOR PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2018-2022

Asy Syifa Nurul Ulya

213209062

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui analisis portofolio optimal pada sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia berdasarkan perhitungan menggunakan *single index model*. Jenis data penelitian ini adalah kuantitatif. Sumber data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder. Metode pengumpulan data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan dokumentasi. Teknik analisis data pada penelitian ini menggunakan *single index model*. Hasil penelitian ini menunjukkan dari 41 sampel saham terdapat 9 saham yang layak masuk portofolio optimal yaitu, Bank Maspion Indonesia Tbk (BMAS) memiliki nilai sebesar 0,737528 dengan proporsi dana 17,12%, Bank MNC Internasional Tbk (BABP) memiliki nilai sebesar 0,489086 dengan proporsi dana 11,35%, Bank Mega Tbk (MEGA) memiliki nilai sebesar 1,811640 dengan proporsi dana 42,04%, Allo Bank Indonesia Tbk (BBHI) memiliki nilai sebesar 0,722755 dengan proporsi dana 16,77%, Bank Bumi Arta Tbk (BNBA) memiliki nilai sebesar 0,197772 dengan proporsi dana 4,59%, Bank Neo Commerce Tbk (BBYB) memiliki nilai sebesar 0,172905 dengan proporsi dana 4,01%, Bank Permata Indonesia Tbk (BNLI) memiliki nilai sebesar 0,106350 dengan proporsi dana 2,47%, Bank Panin Dubai Syariah Tbk (PNBS) memiliki nilai sebesar 0,038804 dengan proporsi dana 0,90%, Bank Ganesha Tbk (BGTG) memiliki nilai sebesar 0,032201 dengan proporsi dana 0,75%.

Kata Kunci: *Portofolio Optimal, Single Index Model, Sub Sektor Perbankan*

ABSTRACT
PORTFOLIO ANALYSIS TO DETERMINE RISK AND RETURN IN THE
BANKING SUB-SECTOR LISTED ON THE INDONESIA STOCK
EXCHANGE IN 2018-2022

Asy Syifa Nurul Ulya

213209062

The purpose of this research is to determine the optimal portfolio analysis in the banking sub-sector listed on the Indonesia Stock Exchange based on calculations using the single index model. This type of research data is quantitative. The data source uses in this research is secondary data. The data collection method used in this research uses documentation. The data analysis technique in this study uses the Single Index Model. The results of this study indicate that from 41 stock samples there are 9 stocks that deserve to be included in the optimal portfolio, namely, Bank Maspion Indonesia Tbk (BMAS) has a value of 0.737528 with a proportion of funds of 17.12%, Bank MNC Internasional Tbk (BAPF) has a value of 0.489086 with a proportion of funds of 11.35%, Bank Mega Tbk (MEGA) has a value of 1.811640 with a proportion of funds of 42.04%, Allo Bank Indonesia Tbk (BBHI) has a value of 0.722755 with a proportion of funds of 16, 77%, Bank Bumi Arta Tbk (BNBA) has a value of 0.197772 with a fund proportion of 4.59%, Bank Neo Commerce Tbk (BBYB) has a value of 0.172905 with a fund proportion of 4.01%, Bank Permata Indonesia Tbk (BNLI) has a value of 0.106350 with a fund proportion of 2.47%, Bank Panin Dubai Syariah Tbk (PNBS) has a value of 0.038804 with a fund proportion of 0.90%, Bank Ganesha Tbk (BGTG) has a value of 0.032201 with a fund proportion of 0.75%.

Keywords: *Optimal Portfolio, Single Index Model, Banking Sub Sector*