

**ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL  
SAHAM-SAHAM PADA INDEKS LQ-45  
MENGUNAKAN MODEL INDEKS TUNGGAL  
PERIODE 2014 – 2015**

**TUGAS AKHIR**

**Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat menempuh Sidang  
Sarjana Strata 1 (S-1)**

**Oleh  
Grhadhikagari  
1352046**



**JURUSAN MANAJEMEN  
FAKULTAS EKONOMI  
UNIVERSITAS KRISTEN MARANATHA  
BANDUNG  
2016**

**ANALYZE OF OPTIMAL PORTFOLIO FORMATION  
SHARES IN LQ-45 INDEX USING SINGLE INDEX  
MODEL PERIOD 2014-2015**

**A Thesis**

**In Partial Fulfillment of The Requirements for The Degree of  
Bachelor of Science in Management**

**By  
Grhadhikagari  
1352046**



**MANAGEMENT DEPARTMENT  
FACULTY OF ECONOMICS  
MARANATHA CHRISTIAN UNIVERSITY  
BANDUNG  
2016**

## KATA PENGANTAR

Penelitian yang berjudul “Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham-Saham pada Indeks LQ-45 Menggunakan Model Indeks Tunggal Periode 2014 – 2015” memiliki tujuan untuk menganalisis pembentukan portofolio optimal saham-saham pada indeks LQ-45 menggunakan model indeks tunggal pada periode pengamatan, selanjutnya penulis juga melakukan perhitungan *return* dan risiko yang diperoleh dari portofolio yang terbentuk.

Penulis menyadari bahwa tugas akhir ini masih jauh dari sempurna dan masih terdapat kekurangan. Penelitian ini hanya berfokus pada pembentukan portofolio optimal saham-saham yang konsisten terdaftar dalam indeks LQ-45 periode 2014-2015 dengan menggunakan model indeks tunggal hasilnya dapat saja berbeda di kemudian hari sehingga tidak dapat menjadi bahan acuan yang pasti.

Penulis mengucapkan terima kasih atas segala bantuan, bimbingan dan dukungan kepada pihak-pihak yang telah membantu dalam penyusunan tugas akhir ini :

1. Bapak Dr. Mathius Tandiontong, S.E., M.M., Ak., CA. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Kristen Maranatha.
2. Ibu Nonie Magdalena, S.E., M.Si. selaku Ketua Prodi Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Kristen Maranatha.
3. Ibu Dini Iskandar, S.E., M.M. selaku dosen pembimbing yang telah membimbing dan memberikan nasihat yang sangat berharga kepada penulis dalam menyelesaikan tugas akhir ini.
4. Ibu Ana Mariana, S.E., M.Si. selaku dosen wali yang selalu memberikan pesan dan nasihat yang bermanfaat bagi penulis.
5. Seluruh dosen Fakultas Ekonomi Universitas Kristen Maranatha yang telah memberikan ilmu pengetahuan kepada penulis selama masa studi.
6. Orang tua tercinta Bapak Rakhmat Nugroho dan Ibu Lis Indriyati , kakak Anindyagari dan Aninditagari atas dukungan dan doanya yang tidak pernah putus.
7. Raden Gandira Rizki Ramadhan, sahabat Vini Avinya, Salsabila Athaya, Eca, Edlyn, Ezra, Gaby, Icel, Syifa, teman-teman perkuliahan, teman-teman aslab metoda kuantitatif dan rekan sejawat lainnya yang selalu memberikan dukungan dan bantuan bagi penulis.
8. Perpustakaan Universitas Kristen Maranatha yang telah membantu penulis untuk mendapatkan informasi yang bermanfaat sampai dengan selesainya tugas akhir ini.

Akhir kata, semoga Allah SWT selalu melimpahkan kasih dan berkatNya kepada semua pihak atas semua kebaikan dan bantuan yang telah diberikan. Semoga tugas akhir ini dapat berguna dan memberi nilai tambah serta wacana baru bagi semua pihak yang membacanya.

Bandung, Desember 2016

Grhadhikagari