

ABSTRAK

PENGGUNAAN SINGLE INDEX DALAM ANALISIS PORTOFOLIO UNTUK MEMINIMUMKAN RISIKO BAGI INVESTOR PADA SAHAM PERUSAHAAN YANG TERCATAT DALAM JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) PERIODE 2016-2019

Oleh

Fitriyana

Penelitian ini bertujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui saham-saham syariah apakah yang memenuhi kriteria portofolio optimal pada saham perusahaan yang tercatat dalam *Jakarta Islamic Indeks* (JII) periode 2016-2019.

Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif deskriptif. Populasi pada penelitian ini adalah seluruh saham yang tercatat dalam *Jakarta Islamic Indeks* (JII) periode 2016-2019. Sampel dalam penelitian ini adalah mengambil seluruh perusahaan yang ada didalam populasi (sensus) di *Jakarta Islamic Index* (JII) periode 2016-2019 sebanyak 30 perusahaan. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah model single index. Hasil penelitian menunjukkan tidak terdapat saham yang masuk dalam kandidat portofolio optimal sesuai dengan *Single Index Model*.

Kata Kunci: portofolio saham, single index, kandidat portofolio, return, dan risiko.

ABSTRACT

**PENGGUNAAN INDEKS TUNGGAL DALAM ANALISIS PORTOFOLIO UNTUK
MEMINIMALKAN RISIKO BAGI INVESTOR SAHAM
PERUSAHAAN TERCATAT DALAM
JAKARTA ISLAM INDEKS (JII)
PERIODE 2016-2019**

By

Fitriyana

The aim of this research is to find out which Islamic stocks meet the optimal portfolio criteria for company shares listed on the Jakarta Islamic Index (JII) for the 2016-2019 period.

This research is a descriptive quantitative research. The population in this study are all stocks listed on the Jakarta Islamic Index (JII) for the 2016-2019 period. The sample in this study was to take all companies in the population (census) in the Jakarta Islamic Index (JII) for the 2016-2019 period as many as 30 companies. The method used in this study is the single index model. The results showed that there were no stocks included in the optimal portfolio candidate according to the Single Index Model.

Keywords: stock portfolio, single index, candidate portfolio, return, and risk.