



**UNIVERSITAS TARUMANAGARA**

**FAKULTAS EKONOMI**

**JAKARTA**

**SKRIPSI**

**PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL TIGA SAHAM IDX30  
PADA MEI 2015**

**DIAJUKAN OLEH :**

**NAMA : BRIAN CALVIN**

**NIM : 115110341**

**UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT-SYARAT**

**GUNA MENCAPAI GELAR**

**SARJANA EKONOMI**

**2015**

**UNIVERSITAS TARUMANAGARA**

**FAKULTAS EKONOMI**

**JAKARTA**

**TANDA PERSETUJUAN SKRIPSI**

NAMA : BRIAN CALVIN  
NO. POKOK MAHASISWA : 115110341  
PROGRAM JURUSAN : S1 / MANAJEMEN  
MATA KULIAH POKOK : MANAJEMEN KEUANGAN  
JUDUL SKRIPSI : PEMBENTUKAN PORTOFOLIO  
OPTIMAL TIGA SAHAM IDX PADA MEI  
2015

Jakarta, Juli 2015

Pembimbing,

(Drs. Maswar Abdi, M.E.)

**UNIVERSITAS TARUMANAGARA**

**FAKULTAS EKONOMI**

**JAKARTA**

**TANDA PERSETUJUAN SKRIPSI**

**SETELAH LULUS UJIAN SKRIPSI/KOMPREHENSIF**

NAMA : BRIAN CALVIN  
NO. POKOK MAHASISWA : 115110341  
PROGRAM JURUSAN : S1 / MANAJEMEN  
MATA KULIAH POKOK : MANAJEMEN KEUANGAN  
JUDUL SKRIPSI : PEMBENTUKAN PORTOFOLIO  
OPTIMAL TIGA SAHAM IDX30 PADA  
MEI 2015

Tanggal: Juli 2015

Ketua Penguji:

(Dr. Ir. Agus Zainul Arifin, M.M.)

Tanggal: Juli 2015

Anggota Penguji:

(Drs. Maswar Abdi, M.E.)

Tanggal: Juli 2015

Anggota Penguji:

(Dr. Yanuar, M.M.)

## ABSTRAK

UNIVERSITAS TARUMANAGARA  
FAKULTAS EKONOMI  
JAKARTA

- (A) BRIAN CALVIN (115110341)
- (B) PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL TIGA SAHAM IDX30 PADA MEI 2015
- (C) xv + 80 halaman, 2015, tabel 15, gambar 1; lampiran 9
- (D) MANAJEMEN KEUANGAN
- (E) *Abstract: This study attempts to form an optimal portfolio of three stocks derived from IDX30 stock index according to realized return from April 2014 to April 2015 with monthly holding period. Optimal portfolio is a portfolio that provides the highest level of expected return for a given level of riskor the lowest risk for a given level of expected return in compare to otherportfolios.The method used in this research is sharpe measure (RVAR). The results of this research showed thatthe optimal portfolio of three stocks consist of 52% BBNI stock, 36% KLBF stock, and 12% ICBP stock. These combination is expected to give 33.66% of expected return with the risk of 21.98% and RVAR of 1.228381.*  
*Keywords: optimal portfolio, sharpe measure, RVAR, IDX30*
- (F) Daftar acuan 20 (2003-2014)
- (G) Drs. Maswar Abdi, M.E.