

ABSTRAK

Nurwantoro, Arsytri Agung. 2021. Skripsi. **Analisis Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Metode Markowitz Pada Perusahaan Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI).** Program Studi Akuntansi, Fakultas Ekonomi, Universitas Panca Marga.

Penelitian dilakukan terhadap Perusahaan Makanan dan Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2017-2019 dengan tujuan untuk mengetahui cara analisis portofolio optimal dengan menggunakan metode Markowitz.

Jenis penelitian yang digunakan adalah kuantitatif, dengan variabel bebas yang digunakan adalah metode Markowitz. Sedangkan variabel terikat yang digunakan dalam penelitian ini adalah *return* dan risiko portofolio. Sampel dalam penelitian ini adalah perusahaan makanan dan minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2017-2019. Pemilihan sampel ditentukan dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Sumber data yang diperoleh dalam penelitian ini melalui situs website perusahaan masing-masing dan Bursa Efek Indonesia. Hasil penelitian menunjukkan bahwa dari 19 sampel terdapat 9 sampel yang menjadi saham portofolio optimal. 9 saham tersebut adalah ICBP, DLTA, MYOR, MLBI, SKLT, ULTJ, STTP, CLEO, dan HOKI yang dapat direkomendasikan untuk pengambilan keputusan investasi di Bursa Efek Indonesia.

Kata Kunci: **Portofolio Optimal, Metode Markowitz, Bursa Efek Indonesia.**

ABSTRACT

*Nurwantoro, Arsytri Agung. 2021. Thesis. **Optimal Portfolio Analysis Using the Markowitz Method in Food and Beverage Companies Listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX).** Accounting Study Program, Faculty of Economics, Panca Marga University.*

The research was conducted on Food and Beverage Companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the 2017-2019 period with the aim of knowing how to analyze the optimal portfolio using the Markowitz method.

This type of research is quantitative, with the independent variable used is the Markowitz method. While the dependent variable used in this study is return and portfolio risk. The sample in this study were food and beverage companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the 2017-2019 period. The sample selection is determined using purposive sampling method. Sources of data obtained in this study through the respective company websites and the Indonesia Stock Exchange. The results showed that of the 19 samples there were 9 samples which became the optimal portfolio stocks. The 9 shares are ICBP, DLTA, MYOR, MLBI, SKLT, ULTJ, STTP, CLEO, and HOKI which can be recommended for making investment decisions on the Indonesia Stock Exchange.

Keywords: **Optimal Portfolio, Markowitz Method, Indonesia Stock Exchange.**