

## ABSTRAK

### Analisis Optimalisasi Pemilihan Saham Pada Saham *Gainers* dan *Most Active* di BEJ Berdasarkan Metode Indeks Tunggal

Katharina Niken Trihapsari  
Universitas Sanata Dharma  
Yogyakarta  
2005

Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisis saham-saham mana yang masih dapat menghasilkan tingkat keuntungan meskipun dalam kondisi pasar modal yang lesu dari sepuluh saham *gainers* dan *most active* sehingga dapat membentuk portofolio optimal guna memberikan manfaat yang tinggi dan keuntungan bagi investor serta mengurangi terjadinya resiko kerugian dari investasi saham.

Teknik pengumpulan data yang digunakan adalah 1). Studi pustaka, dan 2). Dokumentasi. Dalam skripsi ini dibahas mengenai pembentukan portofolio optimal berdasarkan perimbangan proporsi dana yang ditanamkan pada saham-saham yang terpilih dalam portofolio optimal berdasarkan metode indeks tunggal. Dalam analisis ini dipilih sepuluh saham yang masuk dalam saham *Top Gainers* (saham yang memiliki tingkat keuntungan yang tinggi dari kenaikan harga saham) dan *Most Active by Trading Frequency* (saham yang aktif diperdagangkan di bursa efek).

Dari hasil analisis, kesimpulan yang diperoleh adalah dari sepuluh saham *gainers* dan *most active* yang dianalisis dengan Metode Indeks Tunggal hanya dua saham yang masuk portofolio optimal yaitu saham TLKM dan ADES karena kedua saham tersebut mempunyai resiko terkecil dan menghasilkan tingkat keuntungan maksimal.

## ABSTRACT

The analysis of stock election optimalization on  
gainers and most active stock at BEJ  
according to single index method.

Katharina Niken Trihapsari  
Sanata Dharma University  
Yogyakarta  
2005

This research suppose to analyzing which stocks still can producing advantage level although in longitude fund market condition of ten gainers and most active stock so that can form optimal portofolio for give high using advantage and profit for investor and also to reduce damage risk of stock investation.

Data collecting methods that used are 1) Book study and 2) Documentation. In this scription, discussed about optimal portofolio forming according to fund proporsion balancing that invested on chossen stockin optimal portofolio based on single index method. In this analysis, chossed ten stock that enter Top Gainers Stock (stock which have high advantage level from stocks price ascending) and most active by trading frequency (stocks that traded in stocks exchange actively).

From analysis result, the conclusion is from ten gainers and most active stocks which analyzed with single index method only two stock that include optimal portofolio, that are TLKM and ADES stock because both have smallest risk and producing maximum advantage level.