

## BAB V

### SIMPULAN DAN SARAN

#### V.1. Simpulan

Berdasarkan hasil analisis penelitian portofolio optimal yang sudah dilakukan dengan menggunakan metod CAPM dan *Single Index Model* pada pembahasan diatas, maka kesimpulan dari penelitian ini ialah:

1. Berdasarkan penggunaan metode *Capital Asset Pricing Model*, didapatkan 7 emiten perusahaan yang membentuk portofolio optimal pada Indeks IDX30.
2. Berdasarkan penggunaan metode *Single Index Model*, didapatkan 2 emiten perusahaan yang membentuk portofolio optimal pada Indeks IDX30
3. Berdasarkan kinerja portofolionya, apabila menggunakan metode *Capital asset pricing model* didapatkan nilai *return* portofolio sebesar 0.0043 atau 0,43%.
4. Berdasarkan kinerja portofolionya, apabila menggunakan metode *single index model* didapatkan nilai *return* portofolio sebesar 0.0184 atau 1,84%.
5. Berdasarkan analisis screening fundamental saham yang digunakan, didapatkan BBNI dan ICBP sebagai perusahaan yang memiliki nilai terbaik dalam screening fundamental saham.

#### V.2. Saran

Dengan melihat dari hasil analisis, pembahasan, dan juga kesimpulan yang telah dibuat, maka peneliti memiliki saran yaitu:

1. Bagi investor diharapkan penelitian ini dapat menjadi acuan dan bisa membantu dalam mengambil keputusan sendiri untuk membentuk portofolio optimal dengan mendiversifikasikan portofolionya dalam saham BBKA, UNTR, ICBP, BMRI, INTP, SMGR, dan BBNI.

2. Bagi perusahaan yang ter-indeks IDX30 diharapkan penelitian ini dapat menjadi bahan evaluasi agar perusahaan-perusahaan yang terindeks IDX30 bisa masuk kedalam kategori saham pembentuk portofolio optimal.