



**UNIVERSITAS WIDYA MATARAM FAKULTAS EKONOMI
PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN**

RENCANA PEMBELAJARAN SEMESTER (RPS)

MATA KULIAH	KODE	Rumpun MK	Bobot (SKS)	SEMESTER	Tanggal Penyusunan
Teknik Portofolio dan Analisis Investasi	MNJ 501	Teknik Portofolio dan Analisis Investasi	3	5 (Lima)	
OTORISASI	Dosen Pengembang RPS		Koordinator RMK		Koordinator Program Studi
	Dr. Bangun Putra Prasetya, M.Sc.,M.M		Dr. Bangun Putra Prasetya.,M.Sc.,M.M		Ascasaputra Aditya, S.E., M.B.A
Capaian Pembelajaran (CP)	CPL-Prodi yang dibebankan pada mata kuliah				
	CPL1 (S9)	Menunjukkan sikap bertanggungjawab atas pekerjaan di bidang keahliannya secara mandiri;			
	CPL2 (KU1)	Mampu menerapkan pemikiran logis, kritis, sistematis, dan inovatif dalam konteks pengembangan atau implementasi ilmu pengetahuan dan teknologi yang memperhatikan dan menerapkan nilai humaniora yang sesuai dengan bidang keahliannya;			
	CPL3 (KU2)	Mampu menunjukkan kinerja mandiri, bermutu, dan terukur;			
	CPL4 (KU5)	Mampu mengambil keputusan secara tepat dalam konteks penyelesaian masalah di bidang keahliannya, berdasarkan hasil analisis informasi dan data;			
	CPL5 (KK1)	Mampu menyelesaikan masalah rutin fungsi manajemen (perencanaan, pengorganisasian, pengarahan, dan pengendalian) dan fungsi organisasi (pemasaran, sumberdaya manusia, operasi, dan keuangan) dengan kaidah yang berlaku;			
	CPL6 (P1)	Menguasai konsep teori dalam ilmu manajemen dan menerapkannya dalam berbagai tipe organisasi baik bisnis maupun non bisnis;			
	Capaian Pembelajaran Mata Kuliah (CPMK)				
	CPMK1	Mampu memahami konsep dan prinsip manajemen strategi; (CPL1)			
	CPMK2	Mampu menjelaskan tentang pengambilan keputusan strategis dalam manajemen bisnis; (CPL2)			
	CPMK3	Mampu menunjukkan kinerja mandiri, bermutu, dan terukur; (CPL 3)			
	CPMK4	Mampu menjabarkan langkah-langkah dalam proses manajemen strategi bisnis; (CPL5)			
	CPMK5	Mampu menjelaskan dan mempresentasikan masalah dan solusi manajemen strategidalam organisasi bisnis; (CPL 4)			
Kemampuan akhir tiap tahapan belajar (Sub-CPMK)					

	Sub-CPMK1	Mampu menjelaskan mengenai Manajemen Investasi dan Pasar Modal				
	Sub-CPMK2	Mampu menjelaskan serta memahami Pasar Modal Indonesia, Saham dan Obligasi				
	Sub-CPMK3	Mampu menjelaskan <i>return</i> dan risiko aktiva tunggal				
	Sub-CPMK4	Mampu menjelaskan pemilihan porotofolio				
	Sub-CPMK5	Mampu memahami BETA				
Korelasi CPMK dan Sub-CPMK						
	CPMK	Sub CPMK 1	Sub-CPMK 2	Sub CPMK 3	Sub CPMK 4	Sub CPMK 5
	CPMK 1	v		v	v	v
	CPMK 2			v	v	v
	CPMK 3	v	v	v	v	v
	CPMK 4				v	
	CPMK 5			v	v	v
Deskripsi Singkat Mata Kuliah	<p>Pada mata kuliah ini mahasiswa mempelajari tentang :Pengertian investasi dan instrument derivative, proses investasi, istilah-istilah investasi, lingkungan investasi, struktur pasar dan jenis-jenis instrument di pasar modal.Sejarah pasar modal di Indonesia, BAPEPAM, sistem perdagangan di BEI, IHSG, IPO, pasar modal sekunder, dan peran pemerintah dalam pasar modal.Konsep saham, jenis-jenis saham yang ada di pasar modal dan bagaimana mengukur nilai saham.Konsep-konseppenting yang terkait penerbitan dan perdagangan sekuritas di pasar modal. Definisi efisiensi pasar, bentuk-bentuk efisiensi pasar dan pengujian efisiensi pasar.Konsep Risiko, asset berisiko dan capital allocation between risky and the risk free assets.Pengukuran return realisasi, return ekspektasi aktiva tunggal dan return portofolio. Konsep dasar return yang diharapkan dari portofolio, mengukur risiko portofolio, diversifikasi portofolio, memilih portofolio dari aktiva berisiko, modal awal dan modal akhir, kurva indefferen, nonstation dan risk aversion.Pengertian CAPM, asumsi-asumsi CAPM, ekuilibrium pasar modal, portofolio pasar, garis pasar sekuritas, garis pasar modal, Arbitrage pricing model dan Market efficiency.Konsep deviden, Stock split dan Right Issue.Pengertian obligasi, jenis-jenis obligasi, dan manfaat obligasi.Pengertian reksadana, Jenis-jenis reksadana, Manfaat reksadana dan Evaluasi kinerja nilai reksadana.Pengertian derivatif keuangan, jenis-jenis derivatif keuangan, pengukuran nilai derivatif, dan resiko yang dihadapi setiap derivatif keuangan.Analisa makro ekonomi dan industri, Analisis Pasar, Analisa laporan keuangan, Analisis Fundamental dan Analisis Teknikal</p>					
Bahan Kajian:	<p>Materi Pembelajaran</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Pengetahuan, dan Latar Belakang Manajemen Investasi dan Pasar Modal 2. Pasar Modal 3. Pasar Modal Indonesia 4. Saham 5. Nilai Saham 6. Obligasi 7. Return dan Risiko Aktiva Tunggal 8. Return dan Risik Portofolio 9. Pemilihan Portofolio 10. Model Indeks Tunggal 					

	11. Beta						
Penilaian	Adapun komposisi nilai untuk mata kuliah Akuntansi Kerberlanjutan sebagai berikut: Afektif 10% Ujian Tengah Semester 45% Ujian Akhir Semester 45%						
Pustaka	Utama: 1. Jogiyanto Hartono. 2012. Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Kedelapan, BPFE, Yogyakarta. 2. Ary, Tatang Gumanti. 2011. Manajemen Investasi-Konsep, Teori dan Aplikasi, Mitra Wacana Media, Jakarta.						
	Pendukung: 1. Bodie, Kane, Marcus, 2006, "Investment", jilid pertama dan jilid kedua, Salemba Empat, Jakarta. 2. Frank J. Fabozzi, 1999, "Manajemen Investasi", Buku Satu dan Buku Dua, Salemba Empat, Jakarta 3. W.F. Sharpe, G.J. Alexander, J.V. Bailey, 2006, "Investasi", jilid satu dan jilid dua, PT INDEKS Kelompok Gramedia, Indonesia						
Dosen Pengampu	Bangun Putra Prasetya, S.E., M.Sc., M.M						
Mata kuliah syarat	Manajemen Keuangan I dan Manajemen Keuangan II						
Minggu ke-	Kemampuan akhir tiap tahapan belajar (Sub-CPMK)	Penilaian		Bentuk Pembelajaran; Metode Pembelajaran; Penugasan Mahasiswa (Estimasi Waktu)		Materi Pembelajaran (Pustaka)	Bobot Penilaian %
(1)	(2)	Indikator(3)	Kriteria & Teknik (4)	Luring(5)	Daring(6)	(7)	(8)
1	Sub-CPMK1: Mampu menjelaskan mengenai Manajemen Investasi dan Pasar Modal	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan mengetahui Keuangan Korporasi dan Investasi serta mengetahui <i>Money Market</i> dan <i>Capital Maket</i> - Kemampuan menjelaskan investasi serta jenis-jenis investasi - Ketepatan menjelaskan peranan pasar modal. 	Kriteria: <ul style="list-style-type: none"> • Pendahuluan • Visi-Misi Prodi manajemen • Skema Penilaian (<i>Marking scheme</i>) • Kontrak pembelajaran Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah: Diskusi: (PB: 1x (2 x 50")) Tugas-1: (PT + KM: (1+1) x (2x60")) Kuliah: Diskusi dalam kelompok: (PB: 1x (2 x 50")) Tugas-2: (PT + KM: (1+1) x(2x60"))		(RG); (ZD)	

2	Sub-CPMK1: Mampu menjelaskan Mengenai Pasar Modal	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan mengetahui penawaran perdana ke publik - Ketepatan menjelaskan pasar modal sekunder - Kemampuan menjelaskan OTC market 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah: Diskusi: (PB: 1x (2 x 50”) Tugas-3: (PT + KM: (1+1) x (2x60”))		(RG); (GA); (GB)	
3-4	Sub-CPMK2: Mampu menjelaskan serta memahami Pasar Modal Indonesia	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan mengetahui sejarah pasar modal di Indonesia - Ketepatan dalam menjelaskan BAPEPAM-LK - Ketepatan menjelaskan mengenai otoritas jasa keuangan - Kemampuan mengetahui prosedur pendaftaran sekuritas di BEI - Ketepatan menjelaskan sistem perdagangan di BEI - Kemampuan menjelaskan indeks pasar modal - Kemampuan menjalaskn proses 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah; <i>Discovery learning</i> , diskusi dalam kelompok; (PB: 1x (2 x 50”) Tugas-4: (PT + KM: (1+1) x (2x60”))		RG); (SW): (ZD)	

		penyelesaian transaksi					
5.	Sub-CPMK2 : Mampu menjelaskan mengenai saham	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan mengetahui mengenai saham preferen - Kemampuan mengetahui mengenai saham biasa - Kemampuan mengetahui mengenai saham treasuri 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah; Diskusi; (PB: 1x (2 x 50")) Tugas-5: (PT + KM: (1+1) x (2x60"))		(RG); (AF); (ZD)	
6	Sub-CPMK2: Mampu menjelaskan mengenai nilai saham	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan mengetahui nilai buku dan nilai-nilai lainnya - Kemampuan mengetahui mengenai nilai pasar - Kemampuan mengetahui mengenai nilai intrinsik 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah; Diskusi; (PB: 1x (2 x 50")) Tugas-5: (PT + KM: (1+1) x (2x60"))		(RG); (AF); (ZD)	
7-	Sub-CPMK3: Mampu menjelaskan Obligasi	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan menjelaskan mengenai definisi obligasi - Kemampuan menjelaskan mengenai kode obligasi - Kemampuan menjelaskan 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah; Diskusi; (PB: 1x (2 x 50")) Tugas-6: . (PT + KM: (1+1) x (2x60"))		(RG); (CJ); (GB)	

		obligasi seri dan termin. – Kemampuan memahami macam-macam obligasi. – Kemampuan memahami pasar modal, nilai obligasi, likuiditas obligasi, dan hasil obligasi – Kemampuan memahami hak tarik, risiko hasil risiko obligasi, teorema penilaian obligasi dan durasi obligasi – Kemampuan menjelaskan harga obligasi dari perubahan suku bunga					
8	Ujian Tengah Semester (UTS): Melakukan validasi hasil penilaian, evaluasi dan perbaikan proses pembelajaran berikutnya						
9-10	Sub-CPMK3: Mampu menjelaskan <i>return</i> dan risiko aktiva tunggal	– Kemampuan menjelaskan pengukuran return realisasian – Kemampuan menjelaskan return ekspektasian. – Kemampuan memahami risiko. – Kemampuan memahami koefisien variasi.	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	Kuliah: Studi kasus; (PB: 1x (2 x 50’’) Tugas-7: (PT + KM: (1+1) x (2x60’’)			<i>Triple Bottom Line</i> (RG); (SW)

		<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan menjelaskan properti return ekspektasian dan varian. - Kemampuan mmenjelaskan semi variance. - Kemampuaann menjelaskan mean absolute devianto. - Kemampuan menjelaskan hubungan antara return ekspektasian dengan risiko 					
11	Sub-CPMK4: Mampu menunjukkan <i>return</i> dan risiko portofolio	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan menjelaskan return potofolio. - Kemampuan memahami risiko portofolio. - Kemampuan memahami risiko total. - Kemampuan memahami diverifikasi. 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: <ul style="list-style-type: none"> • Kasus-kasus akuntansi keberlanjutan 	Kuliah; <i>Discovery learning</i> , diskusi dalam kelompok; (PB: 1x (2 x 50”) Tugas-8: (PT + KM: (1+1) x (2x60”))			
12	Sub-CPMK3: Mampu menjelaskan pemilihan porotofolio	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan memahami <i>attainable set</i> dan <i>effeeciennntset</i>. 	Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>) Teknik non-test: Meringkas materi	Kuliah; <i>Discovery learning</i> , diskusi dalam kelompok; (PB: 1x (2 x 50”) Tugas-9:		Global Reporting Initiative (RG);	

		<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan dalam menentukan portofolio efisien. - Kemampuan dalam menentukan portofolio optimal. 	kuliah	(PT + KM: (1+1) x (2x60"))		(GR)	
13-14	Sub-CPMK3: Mampu menjelaskan model indeks tunggal	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan menjelaskan model indeks tunggal dan komponen returnnya. - Kemampuan memahami asumsi-asumsi. - Kemampuan memahami varian return sekuritas model indeks tunggal - Kemampuan memahami kovarian return antara sekuritas model indeks tunggal. <p>Kemampuan parameter-parameter input untuk model markowitz.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan memahami analisis portoffolio 	<p>Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>)</p> <p>Teknik non-test:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	<p>Kuliah; <i>Discovery learning</i>, diskusi dalam kelompok; (PB: 1x (2 x 50"))</p> <p>Tugas-10: (PT + KM: (1+1) x (2x60"))</p>		Integrated Reporting (RG); (RM); (KR)	

		<p>menggunakan model indeks tunggal.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan memahami model pasar. - Kemampuan memahami portofolio optimal berdasarkan model indeks tunggal. 					
15	Sub-CPMK5: Mampu Memahami BETA	<ul style="list-style-type: none"> - Kemampuan menjelaskan beta - Kemampuan memahami dalam mengestimasi beta. - Kemampuan memahami beta pasar. - Kemampuan memahami beta akuntansi. - Kemampuan memahami beta fundamental - Kemampuan memahami bea pasar dan beta fundamental - Kemampuan memahami beta portofolio. 	<p>Kriteria: Pedoman Penskoran (<i>Marking scheme</i>)</p> <p>Teknik non-test:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Meringkas materi kuliah 	<p>Kuliah; <i>Discovery learning</i>, diskusi dalam kelompok; (PB: 1x (2 x 50’))</p> <p>Tugas-11: (PT + KM: (1+1) x (2x60’))</p>		(RG); (SW); (GB)	
16	Ujian Akhir Semester (UAS): Melakukan validasi penilaian akhir dan menentukan kelulusan mahasiswa						

1. PB = Proses Belajar, PT = Penugasan Terstruktur, KM = Kegiatan Mandiri



UNIVERSITAS WIDYA MATARAM

FAKULTAS EKONOMI UJIAN TENGAH SEMESTER T.A. 2022/2023

MATA KULIAH	:	Teknik Portofolio dan Analisis Investasi	SEMESTER	:	5 (Lima)
DOSEN	:	Dr. Bangun Putra Prasetya, M.Sc.,M.M	WAKTU	:	120 Menit
HARI/TANGGAL	:		SIFAT UJIAN	:	Close Book

Perhatian:

1. Berdoalah sebelum mengerjakan soal
2. Bacalah soal dengan teliti
3. Periksa kembali jawaban Anda sebelum diserahkan kepada pengawas ujian
4. Lembar soal harap dikumpulkan kembali

1. Jelaskan secara rinci mengenai konsep dasar investasi dan dasar keputusan investasi ! (10 poin)
2. Sebutkan dan Jelaskan Jenis-Jenis Investasi ! (5 poin)
3. Jelaskan secara rinci mengenai kegunaan pasar modal bagi perusahaan ! (5 poin)
4. Komponen jual-beli saham terdiri dari: (40 Poin)
 - ✓ Nilai beli saham + komisi pialang + PPN 10% + Komisi pialang
 - ✓ Nilai jual saham + komisi pialang + PPN 10% + pajak penghasilan 0,1%
 - a. Seorang investor membeli saham PT . Ace Hardware Indonesia Tbk (ACES) sebanyak 10 lot dengan harga per lembar Rp. 825. PPN 10%, dan komisi pialang ditetapkan 0,3% dari pembelian, Maka investor harus membayar
 - b. Investor tersebut menjual kembali sahamnya dengan harga per lembar Rp.900, maka jumlah yang akan diterima dari hasil penjualan saham tersebut adalah:
5. Jika anda sebagai manajer investasi, Berdasarkan beberapa perusahaan yang telah anda pilih, menurut anda perusahaan mana saja yang akan anda pilih dalam melakukan kegiatan portofolio berdasarkan laporan keuangan masing-masing perusahaan, dan berikan alasannya! (40 Poin)

Disusun oleh:	Diverifikasi oleh:	
Dosen Pengampu :	Ketua Program Studi :	Ketua UPMF Fakultas Ekonomi
Tanggal :	Tanggal :	Tanggal :



UNIVERSITAS WIDYA MATARAM

FAKULTAS EKONOMI

Tata Bumi Selatan, Banyuraden, Gamping, Sleman, Daerah Istimewa Yogyakarta 55293

UJIAN AKHIR SEMESTER

MATA KULIAH	:	Teori Portofolio dan Analisis Investasi	SEMESTER	:	5 (Lima)
DOSEN	:	Dr. Bangun Putra Prasetya, M.Sc.,M.M	WAKTU	:	
HARI/TANGGAL	:		SIFAT UJIAN	:	Terbuka

Perhatian:

5. Berdoalah sebelum mengerjakan soal
6. Bacalah soal dengan teliti
7. Periksa kembali jawaban Anda sebelum diserahkan kepada pengawas ujian
8. Lembar soal harap dikumpulkan kembali

1. Jelaskan hubungan antara return ekspektasian dengan risiko incesasi
2. Berdasarkan perusahaan yang ada pada bursa efek yang anda pilih, tentukan portofolio investasi anda ! perusahaan mana saja yang anda pilih, sertakan alasannya dengan perhitungan yang jelas! (Asumsi jika admin fee dihitung 5%, analisis anda pada harga saham mulai bulan september hingga Januari, dengan modal yang sama Rp. 10.000.000)
3. Berdasarkan instumen investasi yang ada baik, Saham, Deposito, Tabungan, mana yang akan anda pilih dengan karakter investor anda masing- masing dan berikan alasannya! (Asumsi jika admin fee dihitung silahkan anda merujuk pada beberapa Bank yang telah anda datangi, dengan modal yang sama Rp. 20.000.000)

SELAMAT MENGERJAKAN

Disusun oleh: Dosen Pengampu :	Diverifikasi oleh: Ketua Program Studi :	Ketua UPMF Fakultas Ekonomi
Tanggal :	Tanggal :	Tanggal :