



SILABUS

PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN

UNIVERSITAS DIAN NUSWANTORO

Mata Kuliah : Teori Portofolio dan Analisis Investasi
Kode Mata Kuliah : P32026
Semester : 2
Sks : 3 sks
Jumlah Pertemuan : 14 kali
Jumlah Jam/ Pertemuan : 2,5 jam
Tim Pembuat : Dosen Udinus

Deskripsi Perkuliahan

Mata kuliah ini membahas konsep dan teknik analisis yang diperlukan dalam pengambilan keputusan investasi khususnya investasi pada sekuritas, baik berupa saham, obligasi, maupun derivatif.

Standar Kompetensi

1. Mahasiswa mampu menjelaskan teori investasi
2. Mahasiswa mampu menjelaskan teknik analisis investasi
3. Mahasiswa mampu menganalisa teori dan teknik analisis yang diperlukan dalam pengambilan keputusan investasi
4. Mahasiswa mampu mengaplikasikan teori dan teknik analisis yang diperlukan dalam pengambilan keputusan investasi

| Pertemuan | Pokok Bahasan | Sub Pokok Bahasan | Referensi |
|-----------|--------------------------|--|------------|
| 1 | Investasi | 1. Pengertian Investasi 2. Proses Investasi 3. Istilah-istilah investasi di pasar modal | 1, 2, 3, 4 |
| 2 | Pasar modal di Indonesia | 1. Sejarah pasar modal di Indonesia 2. BAPEPAM 3. Sistem perdagangan di BEI 4. IHSG 5. IPO 6. Pasar modal sekunder 7. Peran pemerintah dalam pasar modal | 2, 4 |
| 3 | Pasar keuangan dan bunga | 1. Peranan bunga 2. Teori-teori tingkat bunga 3. Preferensi individu pada tingkat bunga | 1, 2, 3, 4 |
| 4 | Saham | 1. Saham preferen 2. Saham biasa | 1, 2, 3, 4 |



SILABUS

PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN

UNIVERSITAS DIAN NUSWANTORO

Mata Kuliah : Teori Portofolio dan Analisis Investasi
 Kode Mata Kuliah : P32026
 Semester : 2
 Sks : 3 sks
 Jumlah Pertemuan : 14 kali
 Jumlah Jam/ Pertemuan : 2,5 jam
 Tim Pembuat : Dosen Udinus

| | | | |
|---|---|---|------------|
| | | 3. Saham treasury 4. Nilai saham <ul style="list-style-type: none"> • Nilai Buku • Nilai Pasar • Nilai Intrinsik | |
| 5 | Teknik analisis dan penilaian investasi saham | 1. Pendekatan penilaian saham <ul style="list-style-type: none"> • Penilaian saham dengan pendekatan laba • Pendekatan nilai sekarang | 1, 2, 3, 4 |
| 6 | Return dan resiko aktiva tunggal | 1. Pengukuran return realisasi 2. Return Ekspektasin aktiva tunggal 3. Risiko aktiva tunggal | 1, 2, 3, 4 |
| 7 | Teori portofolio | 1. Beberapa konsep dasar 2. Return yang diharapkan dari portofolio 3. Mengukur risiko portofolio 4. Diversifikasi portofolio 5. Memilih portofolio dari aktiva berisiko 6. Modal awal dan modal akhir 7. Kurva indifferen 8. Nonstation dan risk aversion 9. Menghitung ekspektasi return | 1, 2, 3, 4 |
| 8 | Capital asset pricing model | 1. Asumsi-asumsi CAPM 2. Ekulibrium pasar modal 3. Portofolio pasar 4. Garis pasar sekuritas 5. Garis pasar modal | 1, 2, 3, 4 |
| 9 | Dividen, right issue, dan harga saham | 1. Bentuk pembayaran dividen 2. Dividen saham 3. Pemecahan saham | 1, 2, 3, 4 |



SILABUS

PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN

UNIVERSITAS DIAN NUSWANTORO

Mata Kuliah : Teori Portofolio dan Analisis Investasi
 Kode Mata Kuliah : P32026
 Semester : 2
 Sks : 3 sks
 Jumlah Pertemuan : 14 kali
 Jumlah Jam/ Pertemuan : 2,5 jam
 Tim Pembuat : Dosen Udinus

| | | | |
|----|---|--|------------|
| | | 4. Right issue | |
| 10 | Obligasi dan reksadana | 1. Pengertian obligasi dan reksadana 2. Jenis-jenis obligasi dan reksadana 3. Manfaat obligasi dan reksadana | 1, 2, 3, 4 |
| 11 | Instrumen derivatif (opsi, kontrak future, warran) | 1. Pengertian instrumen derivatif 2. Jenis-jenis instrumen derivatif | 1, 2, 3, 4 |
| 12 | Efisiensi pasar | 1. Bentuk-bentuk efisiensi pasar 2. Definisi efisiensi pasar 3. Pengujian efisiensi pasar | 1, 2, 3, 4 |
| 13 | Investasi asset riil | 1. Sifat proyek investasi 2. Penghitungan arus kas 3. Penghitungan nilai investasi awal 4. Metode penilaian investasi pada asset riil | 1, 2, 3, 4 |
| 14 | Unit link | 1. Pengertian Unit Link. 2. Bentuk-bentuk Unit Link 3. Manfaat Unit link | 1, 2, 3, 4 |

Referensi

1. Frank K. Reilly dan Keith C. Brown (2006), Investment Analysis and portofolio Management. 8th Edition: Dryden Press, Fort Worth
2. Jogiyanto (1998), Teori Portofolio dan analisis Investasi, Edisi ke-3, BPFE Yogyakarta, Yogyakarta.
3. Sunariyah, (2000), Pengantar Pengetahuan Pasar Modal, Edisi ke-2, Unit Penerbit dan Percetakan Akademi Manajemen YKPN, Yogyakarta
4. Halim, Abdul (2005), Analisis Investasi, Penerbit Salemba Empat, Jakarta.