

KONTRAK PERKULIAHAN

Nama Mata Kuliah : Teori Portofolio dan Analisis Investasi
Kode Mata Kuliah/ SKS : EM4187/ 3 sks
Program Studi : Sarjana Manajemen
Pengajar : Yohana Nonce Naru, S.M., M.M.
Semester : V (Lima)
Hari Pertemuan/ Jam : Jumat/ 17.00 – 19.30
Ruang : offline/online

I. Manfaat Mata Kuliah:

Setelah mengikuti mata kuliah ini, mahasiswa diharapkan memiliki kemampuan untuk memahami teori dan konsep investasi di pasar modal, mengenali berbagai alternatif investasi, serta melakukan analisis terhadap return dan risiko sebagai dasar dalam pengambilan keputusan investasi.

Mahasiswa juga diharapkan mampu memahami konsep portofolio dan diversifikasi serta berbagai model yang digunakan dalam analisis investasi.

II. Deskripsi Mata Kuliah

Pada mata kuliah ini mahasiswa mempelajari berbagai teori dan konsep investasi di pasar modal serta analisis investasi dan berbagai alternatif investasi yang dapat dilakukan oleh calon investor.

Materi yang dibahas meliputi pasar modal Indonesia, saham dan nilai saham, obligasi, return dan risiko aktiva tunggal, return dan risiko portofolio, model indeks tunggal, beta, opsi, Capital Asset Pricing Model (CAPM), efisiensi pasar, serta pasar modal Syariah.

Selain memahami konsep, mahasiswa juga diarahkan untuk memahami penerapan teori dalam kegiatan investasi dan pasar modal serta menganalisis risiko yang mungkin timbul dalam pengambilan keputusan investasi.

III. Proses Pembelajaran:

Dilakukan dengan luring, dengan metode pembelajaran: presentasi, ceramah pakar dan diskusi, studi kasus, analisis dan pembahasan, latihan dan penerapan konsep.

Dalam proses pembelajaran, mahasiswa tidak hanya menerima materi dari dosen, tetapi juga diberikan kesempatan untuk mempelajari, mempresentasikan, mendiskusikan, dan menganalisis materi yang berkaitan dengan investasi dan pasar modal.

IV. Materi Perkuliahan:

1. Pasar Modal Indonesia
2. Saham dan Nilai Saham

3. Obligasi
4. Return dan Risiko Aktiva Tunggal
5. Return dan Risiko Portofolio
6. Model Indeks Tunggal
7. Beta/beta disesuaikan dan Beta untuk Pasar Berkemban
8. Opsi
9. Capital Asset Pricing Model atau CAPM
10. Efisiensi Pasar
11. Model Pasar Syariah
12. Analisis Saham

V. Daftar Referensi:

1. Hartono, Jogiyanto M. 2015. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. BPFE, Edisi 10, Yogyakarta
2. Jones, Charles P, 2007. Investment Analysis and Management. Wiley, Tenth Edition
3. Ayuandiani, W., Nor, W., Aksan, I., Syahrir, N., Wijaya, R., Ariyandani, N., Yulia, I. A., & Ulfha, S. M. (2026). *Teori portofolio dan analisis investasi*. Azzia Karya Bersama.
4. Sapiri, M., Suaib, F., Faridah, & Rahmawati. (2023). Teori portofolio & analisis investasi: Disertai contoh soal & penyelesaian. Nas Media Pustaka.
5. Cesarone, F., Giacometti, R., Martino, M. L., & Tardella, F. (2025). A return-diversification approach to portfolio selection. *Computational Management Science*, 22, Article 12.
6. Asril, M., Saharni, E., Juliani, M., & Rahmat, P. (2024). Membangun portofolio investasi syariah yang berkelanjutan bagi investor pemula. *AMAL: Jurnal Ekonomi Syariah*.

VI. Tugas:

1. Tugas Kelompok
2. Tugas Mandiri

VI. Kriteria Penilaian

Nilai Huruf	Nilai Numerik	Nilai Bobot	Predikat
A	80 – 100	4	Istimewa
B	68 – 79	3	Baik
C	56 – 67	2	Sedang
D	45 – 55	1	Kurang
E	0 – 44	0	Gagal

Dalam menentukan nilai evaluasi akhir akan digunakan pembobotan sebagai berikut :

No	Basis Evaluasi	Komponen Evaluasi	Bobot (%)
1	Aktivitas Partisipatif	Kehadiran, Keaktifan, Partisipasi, Presentasi, Tanggap pembelajaran	50
2	Hasil Proyek	-	0
3	Kognitif / Pengetahuan	Tugas	5
		Quiz	5
		UTS	10
		UAS	30

VIII. Tata Tertib dalam proses pembelajaran

- Toleransi keterlambatan maksimal 15 menit.
- Pengumpulan tugas individu harus dilakukan sesuai dengan jadwal yang telah ditentukan. Tugas yang terlambat mendapatkan nilai maksimal 50% dari nilai yang seharusnya. Keterlambatan lebih dari satu minggu mendapatkan nilai 0.
- Tugas yang merupakan hasil *copy paste* tanpa pengolahan atau sumber yang jelas tidak diterima.
- Aturan jumlah minimal kehadiran, berpakaian sopan, bersepatu dan aturan akademik lainnya tetap berlaku.
- Pada saat pelaksanaan ujian berlaku aturan tata tertib ujian yang diberlakukan di FEB
- Pada saat ujian, bila kedapatan berbuat curang, maka nilai ujian nol/dibatalkan.
- Bila komponen penilaian tidak lengkap tidak akan dapat nilai maksimal
- Tidak ada ujian susulan, kecuali bagi yang sakit dan opname, orang tua meninggal, atau ditugaskan oleh institusi kampus yang diperkuat dengan surat penugasan. Untuk hal ini perlu ada surat pengantar dari institusi untuk ujian susulan.

Kontrak ini dibuat dan disepakati bersama oleh dosen dan mahasiswa, serta berlaku selama perkuliahan berlangsung.

Jakarta, 25 September 2026

Perwakilan Mahasiswa

Dosen Pengampu

Yohana Nonce Naru, S.M., M.M.