



INSTITUT TEKNOLOGI SEPULUH NOPEMBER
FAKULTAS VOKASI
PROGRAM STUDI STATISTIKA BISNIS

Kode Dokumen

VS231532

RENCANA PEMBELAJARAN SEMESTER

MATA KULIAH (MK)			KODE		Rumpun MK			BOBOT (sks)		SEMESTER		Tgl Penyusunan																				
Manajemen Investasi dan Portofolio			VS231532		Statistika Bisnis			T=2		P=0		5 3 Agustus 2023																				
OTORISASI			Pengembang RPS			Koordinator RMK			Ketua PRODI																							
			Fausania Hibatullah			Dwi Endah Kusrini			Brodjol Sutijo Suprih Ulama																							
Capaian Pembelajaran (CP)	CPL-PRODI yang dibebankan pada MK																															
	CPL-3	Mampu mengelola pembelajaran diri sendiri, dan mengembangkan diri sebagai pribadi pembelajar sepanjang hayat untuk bersaing di tingkat nasional, maupun internasional, dalam rangka berkontribusi nyata untuk menyelesaikan masalah dengan mengimplementasikan teknologi informasi dan komunikasi dan memperhatikan prinsip keberlanjutan serta memahami kewirausahaan berbasis teknologi																														
	CPL-4	Mampu menerapkan metode statistika ke dalam prosedur untuk menyelesaikan masalah bisnis dengan memperhatikan faktor keselamatan, industri, ekonomi, sosial, baik secara manual maupun dengan bantuan perangkat komputer																														
	CPL-7	Mampu mengkomunikasikan hasil analisis data baik secara lisan maupun tertulis																														
	CPL-9	Mampu menjelaskan prinsip prinsip bisnis, manajemen dan penjaminan mutu																														
	Capaian Pembelajaran Mata Kuliah (CPMK)																															
	CPMK1	Mampu menjelaskan tujuan dan konsep–konsep dasar manajemen investasi dan manajemen portofolio																														
	CPMK2	Mampu menjelaskan instrumen investasi pasar modal (saham, obligasi dan reksadana)																														
	CPMK3	Mampu menganalisis penilaian instrumen investasi secara fundamental																														
	CPMK4	Mampu menganalisis penilaian instrumen investasi secara teknikal																														
	CPMK5	Mampu menganalisis risk and return aset tunggal dan portofolio																														
	CPMK6	Mampu menganalisis dan menentukan portofolio optimal dengan Metode CAPM (<i>Capital Asset Pricing Model</i>)																														
	CPMK7	Mampu menganalisis dan menentukan portofolio optimal dengan Model APT (<i>Arbitrage Price Theory</i>)																														
	CPMK8	Mampu menganalisis dan menentukan portofolio optimal dengan Model Markowitz																														
			Matrik CPL – CPMK <table><tr><td>CPMK</td><td>CPL-1</td><td>CPL-2</td><td>CPL-3</td><td>CPL-4</td><td>CPL-5</td><td>CPL-6</td><td>CPL-7</td><td>CPL-8</td><td>CPL-9</td></tr><tr><td>CPMK1</td><td></td><td></td><td>V</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td>V</td></tr></table>											CPMK	CPL-1	CPL-2	CPL-3	CPL-4	CPL-5	CPL-6	CPL-7	CPL-8	CPL-9	CPMK1			V					
CPMK	CPL-1	CPL-2	CPL-3	CPL-4	CPL-5	CPL-6	CPL-7	CPL-8	CPL-9																							
CPMK1			V						V																							

Mg Ke-	Kemampuan akhir tiap tahapan belajar (Sub-CPMK)	Penilaian		Bantuk Pembelajaran, Metode Pembelajaran, Penugasan Mahasiswa, [Estimasi Waktu]		Materi Pembelajaran [Pustaka]	Bobot Penilaian (%)
		Indikator	Kriteria & Bentuk	Luring (<i>offline</i>)	Daring (<i>online</i>)		
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
1	1. Mampu menjelaskan tujuan dan konsep–konsep dasar manajemen investasi dan manajemen portofolio	1.1 Mampu menjelaskan pengertian, tujuan dan jenis investasi 1.2 Mampu menjelaskan konsep dasar manajemen investasi 1.3 Mampu menjelaskan karakteristik portofolio 1.4 Mampu menjelaskan konsep dasar manajemen portofolio	1. Observasi di kelas 2. Tes	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Pengertian, tujuan dan jenis-jenis investasi 2. Manajemen investasi 3. Karakteristik portofolio 4. Konsep dasar manajemen portofolio [1], [2] dan [3]	5% / 5%
1	2. Mampu menjelaskan instrumen investasi pasar modal (saham, obligasi dan reksadana)	2.1 Mampu menjelaskan instrumen saham 2.2 Mampu menjelaskan instrumen obligasi 2.3 Mampu menjelaskan instrumen reksadana 2.4 Mampu memahami konsep <i>right, dividen</i> dan <i>warran</i>	1. Observasi di kelas 2. Tes	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Instrumen saham 2. Instrumen obligasi 3. Instrumen reksadana 4. <i>Right, dividen</i> dan <i>warran</i> [1], [2] dan [3]	5% / 10%
2-3	3. Mampu menganalisis penilaian instrumen investasi secara fundamental	3.1 Mampu menganalisis penilaian instrumen investasi berdasarkan fundamental makro 3.2 Mampu menganalisis penilaian instrumen	1. Observasi di kelas 2. Tes 3. Presentasi	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Analisis fundamental makro 2. Analisis fundamental sektoral	15% / 25%

		investasi berdasarkan fundamental sektoral 3.3 Mampu menganalisis penilaian instrumen investasi berdasarkan fundamental perusahaan				3. Analisis fundamental perusahaan [1], [2] dan [3]	
4-5	4. Mampu menganalisis penilaian instrumen investasi secara teknikal	4.1 Mampu menganalisis pola dan tren instrumen investasi 4.2 Mampu membuat keputusan <i>trading</i> berdasarkan metode <i>Moving Average (MA)</i> 4.3 Mampu membuat keputusan <i>trading</i> berdasarkan metode <i>Moving Average Convergence Divergence (MACD)</i>	1. Observasi di kelas 2. Tes 3. Presentasi	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Analisis pola dan tren 2. <i>Moving Average</i> 3. <i>Moving Average Convergence Divergence</i> [1], [2] dan [3]	15% / 40%
6-7	5. Mampu menganalisis risk and return aset tunggal dan portofolio	5.1 Mampu menganalisis risk and return aset tunggal 5.2 Mampu menganalisis risk and return portofolio	1. Observasi di kelas 2. Tes 3. Presentasi	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Risk and return aset tunggal 2. Risk and return portofolio 4. [1], [2] dan [3]	15% / 55%
8	Evaluasi Tengah Semester / Ujian Tengah Semester						
9-11	5. Mampu menganalisis dan menentukan portofolio optimal dengan Metode CAPM (<i>Capital Asset Pricing Model</i>)	6.1 Mampu menjelaskan konsep dan asumsi CAPM 6.2 Mampu menjelaskan ekuilibrium pasar modal	1. Observasi di kelas 2. Tes	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Konsep dan asumsi CAPM 2. Ekuilibrium pasar modal 3. Portofolio pasar	15% / 70%

		6.3 Mampu menjelaskan portofolio pasar 6.4 Mampu menjelaskan garis pasar modal dan garis pasar sekuritas 6.5 Mampu mengevaluasi kinerja portofolio CAPM				4. Garis pasar modal dan pasar sekuritas 5. Evaluasi kinerja portofolio [1], [2] dan [3]	
12-13	6. Mampu menganalisis dan menentukan portofolio optimal dengan Model APT (<i>Arbitrage Price Theory</i>)	7.1 Mampu menjelaskan konsep dan asumsi APT 7.2 Mampu menjelaskan konsep <i>Announcement, Surprise, dan Expected Return</i> di dalam model faktor APT 7.3 Mampu menjelaskan konsep <i>Risk</i> dan Beta 7.4 Mampu menjelaskan konsep portofolio dan model faktor APT 7.5 Mampu menjelaskan konsep hukum satu harga 7.6 Mampu menjelaskan perbedaan antara <i>APT</i> dan <i>CAPM</i> 7.7 Mampu mengevaluasi kinerja portofolio APT	1. Observasi di kelas 2. Tes	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Konsep dan asumsi APT 2. Konsep <i>Announcement, Surprise, dan Expected Return</i> di dalam model faktor APT 3. Konsep <i>Risk</i> dan Beta 4. Konsep portofolio dan model faktor APT 5. Konsep hukum satu harga 6. Perbedaan APT dan CAPM 7. Evaluasi kinerja portofolio [1], [2] dan [3]	15% / 85%
14-15	8. Mampu menganalisis dan menentukan portofolio optimal	8.1 Mampu menjelaskan konsep dan asumsi Model Markowitz	1. Observasi di kelas 2. Tes	1. Ceramah 2. Diskusi 3. Latihan soal	MyITS Classroom	1. Konsep dan asumsi Model Markowitz	15% / 100%

	dengan Model Markowitz	8.2 Mampu menjelaskan konsep portofolio Model Markowitz 8.3 Mampu menentukan portofolio optimal Model Markowitz 8.4 Mampu mengevaluasi kinerja portofolio Markowitz				2. Konsep portofolio Model Markowitz 3. Penentuan portofolio optimal Model Markowitz 4. Evaluasi kinerja portofolio Markowitz [1], [2] dan [3]	
16	Evaluasi Akhir Semester / Ujian Akhir Semester						

Pertemuan ke-	Materi
1	Pengantar Manajemen Investasi dan Portofolio dan Review Instrumen
2	Analisis fundamental dan teknikal
3	Risk and Return aset tunggal dan portofolio
4	Kuis 1
5	Praktik analisis fundamental (rasio keuangan)
6	Praktik analisis fundamental dengan analisis klaster
7	Praktik analisis teknikal (statistical approach)
8	Laporan Project ETS (Minggu ETS)
9	CAPM
10	APT
11	Markowitz
12	Evaluasi Kinerja Portofolio
13	Project Optimasi Portofolio
14	Kuis 2
15	Praktik peramalan return portofolio dengan ARIMA
16	Laporan Project EAS (Minggu EAS)

Evaluasi	CPMK 1	CPMK 2	CPMK 3	CPMK 4	CPMK 5	CPMK 6	CPMK 7	CPMK 8	Total
Kuis 1	2%	3%			5%				10%
Project ETS	3%	2%	15%	5%	5%				30%
Kuis 2						5%	5%	5%	15%
Project EAS				5%	5%	5%	5%	5%	25%
Project Optimasi Portofolio					5%	5%	5%	5%	20%