



**INSTITUT TEKNOLOGI SEPULUH NOPEMBER
FAKULTAS SAINS DAN ANALITIKA DATA
DEPARTEMEN STATISTIKA
PROGRAM SARJANA STATISTIKA**

Mata Kuliah

Nama Mata Kuliah	:	Analisis Finansial
Kode Mata Kuliah	:	SS234634
Kredit	:	3 SKS
Semester	:	VI

DESKRIPSI MATA KULIAH

Mata kuliah Analisis keuangan memiliki materi yang bertujuan agar mahasiswa mengenal instrumen investasi, termasuk pasar keuangan dan produknya, memahami dinamika makroekonomi nasional dan internasional serta hubungannya dengan imbal hasil produk investasi. Selain itu, mahasiswa juga dikenalkan dengan analisis laporan keuangan perusahaan (laporan keuangan – rasio keuangan). Mahasiswa diharapkan mampu menerapkan metode statistik untuk analisis teknikal di pasar keuangan dan mampu menghitung risiko keuangan. Strategi pembelajaran adalah kuliah reguler, kuliah tamu dari praktisi, kunjungan ke Bursa Efek Surabaya, dan penugasan proyek. Sedangkan evaluasi melalui ujian (tertulis/lisan) dan penyampaian proyek.

CAPAIAN PEMBELAJARAN LULUSAN YANG DIBEBANKAN MATA KULIAH

CPL-4	Mampu menerapkan Sains dan Matematika untuk mendukung pemahaman metode statistika
CPL-9	Mampu menerapkan metode statistika untuk menganalisis permasalahan teoritis dan riil.
CPL-10	Mampu menerapkan metode statistika Bisnis, Industri, Ekonomi, Sosial, Kesehatan, atau Lingkungan pada permasalahan riil

CAPAIAN PEMBELAJARAN MATA KULIAH

CPMK.1	Mengenal instrumen investasi
CPMK.2	Memahami risiko investasi yang terkait dengan makroekonomi global
CPMK.3	Memahami risiko dan retron di Capital Market
CPMK.4	Mampu menganalisis laporan keuangan (report) korporat
CPMK.5	Mampu menganalisis kesulitan keuangan dan risiko kredit

POKOK BAHASAN

1. Instrumen investasi
2. Penjelasan tentang inflasi dan hubungannya dengan kesejahteraan, penjelasan tentang indikator makroekonomi yang dapat mempengaruhi inflasi
3. Penjelasan mengenai MLM, skema piramida/ponzi, saham serta persamaan dan perbedaan ketiganya
4. Penjelasan mengenai bentuk-bentuk investasi di bidang properti dan potensi return beserta perkembangan terkini
5. Penjelasan mengenai skema harga minyak internasional dan harga emas internasional serta

kaitannya dengan nilai tukar mata uang utama dunia

6. Penjelasan mengenai jenis dan istilah populer di pasar saham, mitos tentang saham, strategi investasi saham, dan saham berindeks syariah
7. Portofolio investasi dan CAPM
8. Deskripsi laporan keuangan perusahaan secara umum dan khususnya rasio aktivitas, profitabilitas, likuiditas dan solvabilitas
9. Deskripsi metode klasifikasi untuk menghitung risiko kesulitan keuangan dan risiko kredit

PRASYARAT

Analisis Regresi

PUSTAKA

1. Jonathan Berk and Peter DeMarzo. 2019. Corporate Finance, 5th Edition Global Edition. USA: Pearson.
2. Tandelilin, E. (2010), Potfolio dan Investasi, Penerbit Kanisius, Yogyakarta.
3. Prihadi, T., (2011), Analisis Laporan Keuangan: Teori dan Aplikasi, PPM Manajemen.
4. Richard Brealey, Stewart Myers, Franklin Allen and Alex Edmans (2022). Principles of Corporate Finance. 14th Edition. McGraw-Hill.
5. Borak, S., Härdle, W., and Hafner, C. (2011), Statistics of Financial Market: An Introduction, 3rd ed., Springer.
6. Franke, J., Härdle, W., and Cabrera, B-L. (2010), Statistics of Financial Market: Exercise and Solution, Springer.
7. Härdle, W., Hautsch, N., and Overbeck L. (2008), Applied Quantitative Finance, 2nd ed., Springer.
8. Haerdle, W.K., Prastyo, D.D. (2014). Embedded predictor selection for default risk calculation: a Southeast Asian industry study. In: Chuen, D.L.K., Gregoriou, G.N. (eds.) Handbook of Asian Finance: Financial Market and Sovereign Wealth Fund, vol. 1, pp. 131–148. Academic Press, San Diego.