UINAM

PROGRAM STUDI MATEMATIKA

MAT331043. Analisis Real

MAT335066: Matematika Pasar Modal

Semester Ganjil, 2025

Silabus

Mata Kuliah: Matematika Pasar Modal		
Kode MK: MAT335066	**SKS:** 3	**Semester**: 5
Pre-Syarat: -		
Program Studi: Matematika	**Konsentrasi:**	
Penanggungjawab: Nurwahidah	**Pengampu Matakuliah: Nurwahidah**	
Kontak Pengampu: 081343506592		
Jenis Perkuliahan: Teori		

Deskripsi Matakuliah:

Dalam matakuliah ini akan dipelajari tentang insrumen investasi keuangan di pasar modal, mekanisme perdagangan di pasar perdana dan pasar sekunder, mekanisme perdagangan saham. Dalam kuliah ini juga akan dipelajari tentang resiko dan imbal hasil melakukan investasi di pasar modal, serta teknik dan penyusunan portofolio investasi di pasar modal dan strategi investasi di pasar modal.

Standar Kompetensi

Mahasiswa mampu menginterpretasikan konsep pengantar pasar modal, teori portofolio, dan keseimbangan pasar modal.

Kompetensi Dasar

Mahasiswa mampu memahami konsep lingkungan investasi dan instrumen finansial, mekanisme perdagangan sekuritas, mutual funds dan perusahaan investasi, tingkat suku bunga dan premi risiko, risiko dan risk aversion, alokasi kapital, portofolio berisiko yang optimal dan the capital asset pricing model (CAPM), model indeks dan Arbitrage Pricing Theory (APT) dan model Multi Faktor

UINAM

PROGRAM STUDI MATEMATIKA

MAT331043. Analisis Real

Tujuan Pembelajaran

Setelah selesai mengikuti perkuliah matakuliah ini, mahasiswa diharapkan mampu:

1. Menelaah konsep lingkungan investasi
2. Menganalisis instrument finansial
3. Menganalisis mekanisme perdagangan sekuritas
4. Menganalisisi mutial funds dan perusahaan investasi
5. Menganalisis tingkat suku bunga dan premi risiko
6. Mengalisis alokasi kapital (Risky dan free risk asset)
7. Menganalisis portofolio berisiko optimal.
8. Menganalisis CAPM
9. Menganalisis portofolio menggunakan model indeks
10. Menganalisis teori harga arbitrasi (APT) dan model multi faktor

Referensi:

1. Zvi Bodie, Alex Kane & A.J Marcus. 2014. Investments, 10th ed. International edition. McGraw-Hill Irwin, New York
2. Suyasa, N.K.N.S., Dharmawan K., Sari K., 2021, Perhitungan Portofolio Optimal Dengan Metode *Mean-Semivariance* Dan *Mean Absolute Deviation* (Studi Kasus: Indeks Harga Saham Lq45 Periode Februari 2017-Juli 2019), E-Jurnal Matematika Vol. 10(2), Mei 2021, pp. 65-69.
3. Pitriyanti K.M., Dharmawan K., Gandhiadi G.K., 2015, Perbandingan Capital Asset Pricing Model (Capm) Dan Three Factors Model Fama And French (TFMFF) Dalam Mengestimasi Return Saham. E-Jurnal Matematika Vol. 4 (4), November 2015, Pp. 181-187
4. Rodita Y.S., Rosha M., 2022, Analisis Perbandingan Portofolio Optimal *Single Index Model* dan Metode CAPM Menggunakan Indeks Pengukur Sharpe, Treynor, dan Jensen (Studi Kasus Saham *Jakarta Islamic Index*) Pada Masa Pandemi Covid-19. *Journal Of Mathematics UNP* Vol. 7, No. 2, July 2022, pp. 54~61 P-ISSN: 2355-1658 / E-ISSN: 2807-3460

Core 1:

1. Pengantar pasar modal
2. Teori Portofolio
3. Keseimbangan pasar modal

Materi

No	Topic			
1	Aset riil dan aset finansial	3 x 50 menit		
2	Instrumen investasi	3 x 50 menit		
3	Proses perdagangan di bursa	3 x 50 menit		
4	Margin Call dan short sale	3 x 50 menit		
5	Tingkat suku bunga	3 x 50 menit		
6	Holding period return dan nilai utilitas	2 x 50 menit		
7	Aturan penilaian portofolio	3 x 50 menit		
8	Return dan risiko	3 x 50 menit		
9	Portofolio berisiko & kombinasi yang optimal	3 x 50 menit		
10	Portofolio Markowitz, CAPM	3 x 50 menit		

11	Premi risiko pasar	3 x 50 menit		
12	Single index model	3 x 50 menit		
13	Arbitrage Pricing Theory	3 x 50 menit		
14	Peluang arbitrage 2 portofolio pasar	3 x 50 menit		

Komponene Penilaian	Persentase	Huruf	Persentil
▪ Kuis	10%	A	90-100%
▪ Tugas Rumah	30%	B	80-89%
▪ Presentasi	20%	C	70-79%
▪ MID	20%	D	60-69%
▪ Final Tes	20%	E	Dibawah 60%

Website Kuliah

Kuis

Mahasiswa diwajibkan membaca dana atau mempelajari materi perkuliahan untuk perkuliahan berikutnya. Hal tersebut dimaksudkan agar mahasiswa dapat menjawab setiap kuis yang diberikan pada awal perkuliahan. Kuis diberikan dirancang untuk menilai apakah mahasiswa telah membaca materi perkuliahan atau belum yang dimaksudkan agarkan mahasiswa dapat memahami konsep yang disampaikan oleh dosen.

Kuis akan disampaikan oleh dosen sewaktu-waktu tanpa ada pemberi tahuan sebelumnya, agar supaya mahasiswa selalu siap dan ada kemauan untuk mempelajari kembali materi yang telah diberikan.

UINAM

PROGRAM STUDI MATEMATIKA

MAT331043. Analisis Real

Tugas Rumah

1. Tugas dirumah dirancang maksimal sebanyak 5 (lima) kali dalam satu semester
2. Interval Waktu penyelesaian setiap tugas rumah ditentukan sesuai dengan besarnya tugas rumah yang diberikan
3. Tugas rumah akan diposting di google classroom dan akan ditutup sesaat sebelum perkuliahan hari berikutnya dimulai.
4. Jika mahasiswa tidak dapat mengupload ke google classroom sesuai dengan waktu yang ditentukan, alternatifnya dapat disetorkan secara langsung sebelum akhir masa pengumpulan tugas paling lambat 15.30.
5. Jika mahasiswa memutuskan untuk menyerahkan tugas rumah dalam bentuk hard copy, maka mahasiswa tetap wajib mengupload tugas rumah tersebut ke google classroom untuk keperluan penilaian
6. Keterlambatan penyerahan tugas akan dikenakan penalty dengan ketentuan
   90% Terlambat hingga 3 jam,
   80% terlambar hingga 6 jam,
   65% terlambat hingga 12 jam,
   50% terlambat hingga 24 jam,
   0% terlambat lebih darai 24 jam.
7. Tugas rumah wajib dikerjakan dan diskusi kelompok. Namun, tugas tersebut harus diupload secara mandiri oleh setiap mahasiswa dan redaksi penyelesaian tugas tidak boleh sama untuk setiap mahasiswa. Jika terdapat mahasiswa yang memiliki dan menyetorkan tugas yag seluruh redaksinya sama, maka kelompok mahasiswa yang sama akan didiskualifikasi dengan nilai E

Presentase

Setiap mahasiswa harus mempresentasikan tugas dari dosen

UTS:

Ujian MID dilakukan melalui ujian tertulis atau pun bedah jurnal yang akan dipresentasikan di depan kelas.

Final Proyek

Ujian FINAL dilakukan melalui ujian tertulis atau pun bedah jurnal yang akan dipresentasikan di depan kelas.

Kehadiran

Kehadiran dari setiap perkuliahan merupakan hal wajib dan akan diisi pada setiap awal perkuliahan. Tidak ada perbedaan antara ketidakhadiran dengan izin atau tanpa izin, yang dinilai adalah HADIR atau TIDAK HADIR.

Teknologi (software Pendukung)

- Mahasiswa harus mengakses google classroom untuk mendownload materi perkuliahan ataupun meng-upload tugas-tugas yang diberikan oleh dosen.

Prosedur dan Kebijakan dalam Perkuliahan

1. Dosen mewajibkan kepada seluruh mahasiswa yang mentaati seluruh keadaan berikut:
   (a) Serius dalam mengikuti setiap perkuliahan
   (b) Jika libur nasional, minggu yang dimaksudkan dihitung pertemuan dengan ketentuan dinyatakan sebagai libur nasional
   (c) Masuk kelas tepat waktu dengan persiapan kuliah (telah membaca materi yang akan disampaikan, tugas, dll)
   (d) Aktiv dalam setiap perkuliahan untuk meningkatkan kemampuan
2. Tidak ada toleransi dari setiap HP yang berbunyi di dalam kelas. Jika anda membawa hp dalam kelas, pastikan dalam keadaan silent

UINAM

PROGRAM STUDI MATEMATIKA

MAT331043. Analisis Real

Kami telah membaca dengan teliti dan mendiskusikannya dengan pengajar tentang point-point tentu. Kami telah memahami seluruh isi dan kebijakan yang ada dalam silabus ini

_____

TIM Dosen

_____ _____

Tanda Tangga Tanggal

_____

Ketua Program Studi

_____ _____

Tanda Tangan Tanggal

_____

Koordinator Gugus Mutu

_____ _____

Tanda Tangan Tanggal