

ABSTRAK

Syahputra, Widi Chandra. 2022. Penerapan Metode Capm (Capital Asset Pricing Model) Untuk Menentukan Pilihan Investasi Pada Saham (Studi Pada Perusahaan Sektor *Consumer Good Industry* di Bursa Efek Indonesia Periode 2018-2020).

Penelitian ini dilakukan untuk menganalisis penerapan metode *Capital Asset Pricing Model* (CAPM) pada perusahaan sektor Consumer Goods Industry yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2018 – 2020.

Populasi dalam penelitian ini adalah 57 perusahaan *Consumer Goods Industry* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2018 – 2020. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini terdiri dari 53 perusahaan. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah metode purposive sampling. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder berdasarkan publikasi pada Bursa Efek Indonesia.

Hasil penelitian ini menemukan bahwa ada 40 saham efisien karena saham tersebut memiliki tingkat pengembalian saham individu lebih besar dari tingkat pengembalian yang diharapkan, untuk saham efisien keputusan yang diambil adalah membeli saham tersebut dan 13 saham tidak efisien karena saham tersebut memiliki tingkat pengembalian saham individu lebih besar dari tingkat pengembalian yang diharapkan, untuk saham tidak efisien keputusan yang diambil adalah menjual saham tersebut.

Kata Kunci : CAPM, Beta Saham, Keputusan Investasi