UNIVERSITAS PENDIDIKAN INDONESIA

RENCANA PEMBELAJARAN SEMESTER (RPS)

IDENTITAS MATA KULIAH

Nama Mata Kuliah	Kode Mata Kuliah	Sks	Workload	Kelompolk Matakuliah	Semester	Matakuliah Pra-Syarat	Tanggal Terbit
MANAJEMEN INVESTASI DAN PASAR MODAL	MJ792	3	135	Pengembangan Keahlian Bidang Ilmu (PKBI)	2		2026-02-11 10:06:49

Dibuat Oleh Dosen Pengampu	Diperiksa Oleh TPK Program Studi	Disetujui Oleh Ketua Program Studi
Dr. Toni Heryana	Layung Anindya P., S.T., M.S.M	MAYA SARI, SE MM

DESKRIPSI MATA KULIAH DAN CPL

Deskripsi Matakuliah	Mata kuliah ini bertujuan untuk membekali mahasiswa dengan pengetahuan dan keterampilan dalam merancang strategi investasi dan memahami dinamika pasar modal. Mata kuliah ini mencakup analisis teori investasi, manajemen portofolio, dan mekanisme pasar modal untuk mempersiapkan mahasiswa dalam membuat keputusan investasi yang cerdas dan efektif. Mahasiswa akan mempelajari berbagai instrumen investasi, teknik evaluasi investasi, dan strategi untuk mencapai tujuan keuangan individu dan institusi di pasar modal.		
CPL yang dibebankan Pada Matakuliah	1	Menguasai pengetahuan konsep teoritis dan praktis manajemen (keuangan, pemasaran, SDM dan produksi/operasi) secara mendalam untuk berperan dalam dunia kerja, baik di unit kerja/usaha dan perusahaan, instansi pemerintah atau lembaga nirlaba	
	2	mampu mengimplementasikan dan mengembangkan ilmu, teori serta kerangka konspetual manajemen dan bisnis.	
	3	Mampu memecahkan permasalahan organisasi melalui kaidah manajemen dan bisnis dengan pendekatan inter atau multi disipliner	
Capaian Pembelajaran Mata Kuliah (CPMK)	1	Mahasiswa dapat menyusun dan mengelola portofolio investasi dengan mempertimbangkan tujuan investasi, profil risiko, dan kondisi pasar.	
	2	Mahasiswa dapat mengevaluasi kelayakan investasi menggunakan analisis fundamental dan teknikal, serta melakukan monitoring dan evaluasi secara teratur.	
	3	Mahasiswa dapat merancang strategi investasi yang adaptif dan inovatif menggunakan teknologi digital untuk meningkatkan ketepatan analisis pasar dan prediksi tren investasi.	
	4	Mahasiswa dapat menyusun rencana strategis investasi jangka panjang yang responsif terhadap perubahan pasar	
Sub-CPMK	1	CPMK - 1	Menganalisis tujuan investasi dan struktur pasar modal dalam konteks manajemen portofolio modern.
	2	CPMK - 1	Menganalisis dan mengukur risiko serta return portofolio menggunakan pendekatan kuantitatif.
	3	CPMK - 2	Mengaplikasikan model pemilihan portofolio dan model keseimbangan pasar dalam pengambilan keputusan investasi.
	4	CPMK - 2	Mengevaluasi instrumen keuangan menggunakan pendekatan valuasi fundamental.
	5	CPMK - 3	Menganalisis dan mengevaluasi strategi pengelolaan portofolio saham serta implikasi efisiensi pasar.
	6	CPMK - 3	Mengaplikasikan analisis teknikal dalam mendukung keputusan investasi
	7	CPMK - 4	Menganalisis dan merancang strategi penggunaan instrumen derivatif untuk tujuan lindung nilai dan manajemen risiko.
	8	CPMK - 4	Menyusun strategi investasi komprehensif berbasis integrasi analisis fundamental, teknikal, dan kondisi makroekonomi global
	9	CPMK - 4	Menyusun strategi investasi komprehensif berbasis integrasi analisis fundamental, teknikal, dan kondisi makroekonomi global
Materi perkuliahan	1	Tujuan dan Ruang Lingkup Investasi	
	2	Pengenalan Pasar Modal	

	3	Return yang Diharapkan dan Risiko Portfolio
	4	Pemilihan Portfolio
	5	Penilaian Obligasi
	6	Penilaian Saham
	7	Strategi Portfolio Saham
	8	Efisiensi Pasar
	9	Analisis Teknikal
	10	Pengenalan Instrumen Derivatif
	11	Model Keseimbangan
Hasil belajar yang dapat diperagakan/ditunjukkan dengan bukti di akhir perkuliahan *)	Mahasiswa mampu merancang strategi investasi dan memahami dinamika pasar modal. mahasiswa mampu mengevaluasi instrumen investasi, teknik investasi dan menciptakan portofolio yang optimal.	
Strategi Pembelajaran		Case Method
		Team based Project
	✓	Lainnya
Langkah Pembelajaran	Pembelajaran dilaksanakan menggunakan metode kasus (case method) secara blended, memadukan perkuliahan sinkron melalui tatap muka dan asinkron melalui penugasan mandiri. Keseluruhan pembelajaran dibagi menjadi dua bagian yang dipisahkan oleh Ujian Tengah Semester (UTS). Pembelajaran diakhiri dengan penyampaian tugas proyek yang harus dikerjakan mahasiswa sebagai pengganti UAS.	
Referensi	1	Bodie, Zvi, (2023), Investments, McGraw-Hill Education
	2	Fabozzi, Frank J., (2002), Capital markets, Prentice-Hall
	3	Elton, Edwin J., (1995), Modern Porfolio Theory and Investment Analysis, Joh Wiley & Sons
	4	Van Horne, James C. and Wachowicz, John M., (1992), Fundamentals of financial management, Prentice-Hall, Inc
	5	Dayan Hakim, (2022), Manajemen investasi dan teori portofolio, Penerbit Andi
	6	Husnan, Suad, (2012), Dasar-dasar teori portofolio dan analisis sekuritas, AMP YKPN

RENCANA PEMBELAJARAN

Minggu ke	Sub-CPMK	Indikator Capaian sub-CPMK yang dapat ditunjukkan oleh mahasiswa	Materi Perkuliahan	Asesmen		Bentuk dan metode pembelajaran		Durasi (jam)	Nomor Referensi	Waktu Akses
				Bentuk Asemen (test/non-tes)	Bobot Penilaian(%)	Sinkron (tatap muka dan tatap maya)	Asinkron (tugas mandiri dan tugas kelompok)			
1	Menganalisis tujuan investasi dan struktur pasar modal dalam konteks manajemen portofolio modern.	Memahami jenis dan instrumen investasi; Menjelaskan trade-off risk–return; Mengklasifikasikan tujuan investasi berdasarkan horizon dan profil risiko	Tujuan dan Ruang Lingkup Investasi	Lainnya	5	Sinkronous	-	3	1,2,5	02-02-2026 13:00
2	Menganalisis tujuan investasi dan struktur pasar modal dalam konteks manajemen portofolio modern.	Menjelaskan fungsi pasar modal dalam sistem keuangan; Membedakanjenis-jenis pasar; Menganalisis peran regulator dan self regulatory organization	Pengenalan Pasar Modal	Lainnya	5	Sinkronous	-	3	1,3,5	09-02-2026 13:00
3	Menganalisis dan mengukur risiko serta return portofolio menggunakan pendekatan kuantitatif.	Menghitung expected return individual & portofolio; Menghitung variance, standar deviasi, dan kovarians; Menginterpretasikan hubungan korelasi antar aset	Return yang Diharapkan dan Risiko Portfolio	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,3,5	23-02-2026 13:00
4	Mengaplikasikan model pemilihan portofolio dan model keseimbangan pasar dalam pengambilan keputusan investasi.	Menyusun efficient frontier; Mengidentifikasi portofolio optimal berdasarkan risk preference; Menggunakan pendekatan mean-variance optimization	Pemilihan Portfolio	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,4,5	02-03-2026 13:00
5	Mengaplikasikan model pemilihan portofolio dan model keseimbangan pasar dalam pengambilan keputusan investasi.	Menjelaskan asumsi dan implikasi CAPM; Menghitung beta dan expected return menggunakan CAPM; Mengevaluasi kelebihan dan keterbatasan CAPM & APT	Model Keseimbangan	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,4,5,6	09-03-2026 13:00

Minggu ke	Sub-CPMK	Indikator Capaian sub-CPMK yang dapat ditunjukkan oleh mahasiswa	Materi Perkuliahan	Asesmen		Bentuk dan metode pembelajaran		Durasi (jam)	Nomor Referensi	Waktu Akses
				Bentuk Asemen (test/non-tes)	Bobot Penilaian(%)	Sinkron (tatap muka dan tatap maya)	Asinkron (tugasmandiri dantugas kelompok)			
6	Mengaplikasikan model pemilihan portofolio dan model keseimbangan pasar dalam pengambilan keputusan investasi.	Menjelaskan asumsi dan implikasi CAPM; Menghitung beta dan expected return menggunakan CAPM; Mengevaluasi kelebihan dan keterbatasan CAPM & APT	Model Keseimbangan	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,4,5,6	16-03-2026 13:00
7	Mengevaluasi instrumen keuangan menggunakan pendekatan valuasi fundamental.	Menghitung harga obligasi; Menghitung yield to maturity (YTM); Menganalisis risiko suku bunga dan durasi	Penilaian Obligasi	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,3,4,5	30-03-2026 13:00
8	UTS				15					06-04-2026 13:00
9	Mengevaluasi instrumen keuangan menggunakan pendekatan valuasi fundamental.	Menggunakan Dividend Discount Model (DDM); Menggunakan pendekatan PER & PBV; Menginterpretasikan hasil valuasi dalam konteks pasar	Penilaian Saham	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas Kelompok	3	1,3,4	13-04-2026 13:00
10	Menganalisis dan mengevaluasi strategi pengelolaan portofolio saham serta implikasi efisiensi pasar.	Membedakan strategi aktif vs pasif; Mengukur kinerja portofolio (Sharpe, Treynor, Jensen); Mengevaluasi rebalancing strategy	Strategi Portfolio Saham	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,3,5,6	20-04-2026 13:00
11	Menganalisis dan mengevaluasi strategi pengelolaan portofolio saham serta implikasi efisiensi pasar.	Menjelaskan bentuk efisiensi pasar (weak, semi-strong, strong); Menguji abnormal return sederhana; Mengkritisi relevansi EMH di pasar berkembang	Efisiensi Pasar	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas Kelompok	3	1,5	27-04-2026 13:00
12	Mengaplikasikan analisis teknikal dalam mendukung keputusan investasi	Menginterpretasikan trend dan pola grafik; Menggunakan indikator teknikal (MA, RSI, MACD); Menyusun rekomendasi trading berbasis teknikal	Analisis Teknikal	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas Kelompok	3	1,2,5	04-05-2026 13:00

Minggu ke	Sub-CPMK	Indikator Capaian sub-CPMK yang dapat ditunjukkan oleh mahasiswa	Materi Perkuliahan	Asesmen		Bentuk dan metode pembelajaran		Durasi (jam)	Nomor Referensi	Waktu Akses
				Bentuk Asemen (test/non-tes)	Bobot Penilaian(%)	Sinkron (tatap muka dan tatap maya)	Asinkron (tugasmandiri dantugas kelompok)			
13	Menganalisis dan merancang strategi penggunaan instrumen derivatif untuk tujuan lindung nilai dan manajemen risiko.	Menjelaskan mekanisme kontrak futures dan options; Menghitung payoff dan profit diagram; Merancang strategi hedging sederhana	Pengenalan Instrumen Derivatif	Pilihan Berganda	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,2,5	11-05-2026 13:00
14	Menyusun strategi investasi komprehensif berbasis integrasi analisis fundamental, teknikal, dan kondisi makroekonomi global	Menjelaskan mekanisme kontrak futures dan options; Menghitung payoff dan profit diagram; Merancang strategi hedging sederhana	Pengenalan Instrumen Derivatif	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas Kelompok	3	1,4,6	18-05-2026 13:00
15	Menyusun strategi investasi komprehensif berbasis integrasi analisis fundamental, teknikal, dan kondisi makroekonomi global	Mengintegrasikan teknologi digital dalam strategi investasi.	Strategi Portfolio Saham	Lainnya	5	Sinkronous	Tugas mandiri	3	1,5	25-05-2026 13:00
16	UAS				15					08-06-2026 13:00