

ABSTRAK

Penelitian ini membahas kinerja saham perusahaan teknologi dan perusahaan makanan di Korea Selatan pada periode Januari 2019-November 2024 yang diminati investor asing karena posisinya yang strategis dalam ekonomi global. Akan tetapi, perusahaan tidak selalu menunjukkan kinerja yang baik. Oleh karena itu, diperlukan strategi investasi yang cermat, termasuk dalam penyusunan dan pengelolaan portofolio. Dalam menyusun portofolio, penelitian ini menggunakan strategi *smart beta* yang telah terbukti memberikan *return* yang lebih unggul dibandingkan dengan portofolio tradisional. Pengelolaan portofolio melibatkan dua strategi, yaitu strategi pasif dan strategi aktif. Penelitian deskriptif kuantitatif ini menggunakan data *open price* dari harga saham yang membentuk portofolio berdasarkan beta yang dipilih. Pembobotan disesuaikan untuk saham beta yang lebih tinggi dalam menerima alokasi yang lebih besar dalam portofolio. Penelitian ini membandingkan tiga kelompok beta (tinggi, sedang, dan rendah) dan dua strategi investasi (pasif dan aktif) dengan menggunakan indeks Sharpe. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa kelompok beta sedang dan strategi pasif memiliki kinerja yang lebih baik dengan nilai *return* yang kompetitif tanpa harus menghadapi terlalu banyak risiko. Strategi pasif memberikan keseimbangan antara risiko dan *return* serta menjaga stabilitas tanpa ketergantungan pada pergerakan pasar yang cenderung fluktuatif.

Kata Kunci: investasi, beta saham, strategi investasi, portofolio