

Pasar modal syariah dan faktor yang mempengaruhi beta saham: studi kasus JII dan Lq-45 tahun 2002-2003

Nurul Huda

Deskripsi Dokumen: <http://lib.ui.ac.id/opac/ui/detail.jsp?id=73981&lokasi=lokal>

Abstrak

Untuk memenuhi kepentingan pemodal yang ingin mendasarkan kegiatan investasinya berdasarkan kepada prinsip-prinsip syariah maka pemerintah telah meluncurkan pasar modal syariah. Hingga saat ini baru terdapat 3 jenis instrumen pasar modal syariah yaitu:

1). Saham-saham yang tercatat pada M,

2). Obligasi syariah/obligasi mudharabah dan

3). Reksa dana syariah.

Beta saham adalah ukuran risiko sistematis dari suatu sekuritas yang merupakan bagian dari risiko total dan tidak bisa dikurangi atau dihilangkan dengan diversifikasi.

Tesis ini mengkaji tentang pasar modal syariah yang dilakukan secara kualitatif dan faktor-faktor yang mempengaruhi beta saham (tiga variabel independent : current ratio, leverage dan return on equity) yang dilakukan secara kuantitatif dengan pendekatan persamaan regresi linier berganda.