

Dampak IHSG, nilai tukar uang dan harga komoditi dunia terhadap return reksadana syariah campuran

Retno Sulistyowati, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=119878&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini membahas dampak IHSG, nilai tukar rupiah terhadap USD (Kurs USD) dan harga komoditi dunia yang diwakilkan dengan harga emas dunia dan harga CPO dunia terhadap return reksadana syariah campuran. Dengan menggunakan data sekunder mingguan dalam periode penelitian sejak tanggal 13 Januari 2006 sampai dengan tanggal 07 Desember 2007. Penelitian ini kuantitatif dengan menggunakan uji regresi linier dan model distributed lag terhadap obyek penelitian yaitu empat reksadana syariah campuran yang eksis pada periode penelitian.

Hasil penelitian menyarankan agar Investor dalam mengantisipasi pergerakan return reksadana syariah khususnya yang berbasis campuran agar memperhatikan pergerakan harga komoditi dunia yang diwakili oleh emas dan CPO disamping pergerakan IHSG dan Kurs USD. Karena sampai saat ini sektor perkebunan dan pertambangan merupakan kapitalisasi terbesar dalam reksadana di Indonesia termasuk reksadana syariah.

<hr>

The focus of this study is about the impact of Jakarta Composite Index, Exchange Rate and Commodities Price in the International Market that are represented by Gold and Crued Palm Oil (CPO) to the Return of Mixture Shariah Mutual Fund. By using weekly secondary data during the research period from the 13th January 2006 until 07th December 2007. This research is quantitave by using linear regression test and distributed lag model to the research objects namely from Mixture Shariah Mutual Fund which exist in the research period.

The research result suggested the investor in anticipating the movement of the return shariah mutual fund, especially which is based on mixture type, to pay attention the movement of commodities price in the international market, represented by Gold and Crued Palm Oil (CPO) beside the movement of Jakarta Composite Index and Exchange Rate.