

Penerapan Prinsip Portfolio dalam Diversifikasi Indeks Saham Internasional bagi Investor Indonesia (Periode Pengamatan 1997-2003)

Fajar Rusyatno, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20185183&lokasi=lokal>

Abstrak

Perkembangan Pasar Modal Dunia membuka kesempatan bagi investor untuk berinvestasi pada beragam sekuritas. Modern Portfolio Theory memberikan metode bagi investor untuk menentukan alokasi asset yang optimal. Dengan berinvestasi ke luar negeri, pengaruh pergerakan nilai tukar mata uang harus diberi perhatian khusus, seperti pada masa ketika dan setelah Indonesia dilanda krisis ekonomi. Hasil penelitian ini adalah saran alokasi asset dan pembobotannya, yang juga menunjukkan bahwa perubahan weighting asset dalam efficient portfolio dipengaruhi oleh besarnya gain (loss) dan nilai tukar mata uang terhadap rupiah. Dalam periode 1997-2003, Investor Indonesia dimungkinkan memperoleh karakteristik risk return investasi yang lebih baik dengan melakukan investasi internasional terutama bila memiliki prediksi pergerakan harga asset dan nilai tukar mata uang di masa depan.