

Analisis pembentukan dan evaluasi kinerja portofolio kelompok saham lq 45 pada bursa efek Indonesia periode 2005-2009 = Analysis of construction and portfolio performance LQ 45 and non LQ 45 stocks at Bursa Efek Indonesia on period 2005-2009

Kario Tientien, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20253006&lokasi=lokal>

Abstrak

Karya akhir ini bertujuan untuk membentuk dan membandingkan optimal portofolio saham yang tergabung dalam indeks LQ 45 dan non LQ 45 yang terdapat di Bursa Efek Indonesia. Saham dibagi menjadi lima kelompok yang terdiri dari satu kelompok saham LQ 45 dan empat kelompok saham non LQ 45. Penelitian ini adalah penelitian kuantitatif dengan menggunakan metode Markowitz.

Hasil penelitian selain menunjukkan bahwa kelompok saham non LQ 45 (1) memiliki return dan kinerja portofolio yang lebih baik dibandingkan kelompok saham LQ 45, juga menunjukkan bahwa saham pada sektor keuangan hampir selalu muncul pada setiap kelompok saham sebagai bagian dari kombinasi saham pembentuk portofolio optimal, diikuti dengan saham pada sektor industri barang konsumsi.....This research aimed to form and compare optimal portfolio of LQ 45 and non-LQ 45 stocks. The stocks were divided into five groups; one group of LQ 45 stocks and four groups of non-LQ 45 stocks. A quantitative analysis using Markowitz model was performed.

The result showed that non-LQ 45 (group I) has a better return and portfolio performance than LQ 45 stocks group. It also showed that the stocks in financial sector are the most often appear in every stocks group as a portion that forms the optimal portfolio, followed by stocks in consumer sector.