

Analisis tingkat pengembalian saham sektor industri barang konsumsi pada periode krisis perekonomian global 2008-2011 = Analysis on return of stock of consumer goods industry sector in global economic crisis 2008-2011

Indra Tertiari Efka, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20333257&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan menganalisis kinerja tingkat pengembalian saham Indeks Sektor Industri barang Konsumsi, yang merupakan kumpulan emiten yang bergerak di bidang konsumsi rumah tangga, dan membandingkannya dengan indeks sektoral lainnya. Analisis dilakukan dengan penerapan rasio Sharpe dan Treynor serta penentuan potensi diversifikasi melalui perhitungan koefisien korelasi terhadap Indeks harga Saham Gabungan. Periode analisis kinerja ini dilakukan pada periode 2008-2011 yang merupakan periode krisis perekonomian global. Penelitian ini juga menganalisis faktor-faktor makroekonomi yang mempengaruhi tingkat pengembalian saham Indeks Sektor Industri Konsumsi dengan pendekatan regresi linear berganda pada periode 2001-2011.

.....This research analyzes stock return performance of Consumer Goods Industry Index, which consists of industries in the field of household consumer goods, and then compares it with other sectoral indexes. Analysis is conducted with the implementation of Sharpe and Treynor Ratio as well as determining the diversification potential through calculation of correlation coefficient against the Composite Index. The period of performance analysis is 2008-2011 which is when the global economic crisis happened. This research also analyzes macroeconomic factors that influence the stock return of Consumer Goods Industry Index through the approach of multiple linear regressions on period 2001-2011.