

Kinerja portofolio saham pada perusahaan makanan, properti dan pertambangan di bursa efek indonesia / Nasri Zarman

Nasri Zarman, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20463304&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui bagaimana kinerja Portofolio Saham pachi Perusahaan Makanan, Properti dan Pertambangan di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini menggunakan 3 parameter yaitu; Kinerja Sharpe, Kinerja Traynor dan Kinerja Jensen. Ketiga pengukuran kinerja tersebut mengasumsikan adanya hubungan linear antara pengembalian (return) portofolio dengan pengembalian dari beberapa indeks pasar. Selama periode 2009- 2013, dan sub sektor pertambangan dan gas yang paling tinggi hasilnya dibandingkan sub sektor yang lain, sektor pertambangan lebih baik dari Sektor Property dan Sektor Makanan, kemudian ditinjau dari Metode Jensen ALPHA menunjukkan kinerja yang tertinggi yaitu kelompok saham sektor pertambangan, sebanding dengan risikonya juga sangat tinggi. Saran dalam penelitian ini, sebaiknya kinerja yang telah ada dipertahankan dan lebih ditingkatkan sehingga misi untuk mengembangkan sumber-sumber energi potensial menjadi portofolio investasi yang menguntungkan terus berlanjut.