

Analisis perbandingan kinerja portofolio (studi kasus : indeks syariah dan indeks konvensional)

Alfiyan Toni, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=74821&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan dari pengukuran kinerja portofolio adalah untuk mengidentifikasi kemampuan/kinerja suatu portofolio, baik dari tingkat keuntungan yang dihasilkan maupun tingkat risiko dari indeks tersebut. Ada dua cara yang bisa dilakukan untuk menilai kinerja suatu indeks yaitu dengan melakukan perbandingan secara langsung maupun dengan menggunakan ukuran kinerja tertentu.

Tujuan utama dari penelitian yang dilakukan adalah mencoba membandingkan kinerja indeks syariah yaitu Jakarta Islamic Index (JII) sebagai proxy kinerja investasi etis dengan kinerja indeks LQ45 dan indeks harga saham gabungan (IHSG) sebagai proxy kinerja investasi pasar dan indeks keuangan (Finance) sebagai proxy kinerja investasi ribawi.

The goal of portfolio analysis is to identify the ability/performance of portfolio by comparing return and risk of that portfolio. There are two methods, which can be done to measure the portfolio performance. First, by comparing directly and second, by using certain parameter.

Main goals of this thesis is trying to compare the performance of Islamic investment portfolio represented by Jakarta Islamic index (JII) as a proxy of ethical investment with the performance of LQ45 and IHSG proxy as a proxy of market performance and Finance index as proxy of interest bearing investment.