

Analisa Portofolio Saham syariah di Bursa efek Indonesia periode 2010-2014 = Analysis Performaces of sharia share portofolio on BEI for the year 2010-2014

Danu Ardi Kuncoro, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920534505&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui kondisi kinerja portofolio saham syariah periode 2010-2014. Selain itu juga mengetahui pengaruh sharia screening process terhadap kinerja suatu portifolio saham syariah.

Desain penelitian ini adalah menghitung kinerja portofolio saham syariah dan portofolio saham konvensional. setelah itu hasil dari kedua kinerja tersebut dibandingkan untuk kemudian di analisa. Penelitian ini juga membandingkan kinerja dari hasil screening dengan kriteria Dow Jones Islamic market index (DJIMI) untuk dibandingkan dengan hasil screening Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI). Pada penelitian ini digunakan metode equally weighted untuk menghitung nilai indeks portofolio. Parameter yang digunakan untuk menghitung kinerja adalah penilaian sharpe, treynor, dan Jensen alpha indeks.

Hasil penelitan menunjukkan bahwa kinerja portofolio saham syariah tahun 2010-2014 lebih baik dari portofolio saham konvensional, dibeberapa kriteria, sharia screening process berpengaruh baik terhadap kinerja suatu portofolio saham syariah. Begitu juga dengan kriteria sharia screening process yang diterapkan pada DJIMI.

.....The purpose of this study was to determine the performance of Islamic stock portfolio during the 2010-2014 period. It also know the effect of sharia screening process on the performance of a sharia stock portifolio.

This study is to calculate the performance of a sharia stock portifolio and conventional stock portifolio. After the results both of portofolio performance compared to be analyzed. The study also compared the performance of the screening results with the criteria of the Dow Jones Islamic market index (DJIMI) with the results of screening Indonesia Sharia Stock Index (ISSI). In this study used equally weighted method to calculate the value of the index portifolio. The parameters used to calculate the performance is the assessment Sharpe, Treynor, and Jensen alpha index.

The result of this study indicates the the performance of sharia stock portofolio of the year 2010-2014 is better then conventional stock portofolio. on several criteria, sharia screening process give good affect to performance of a sharia stock portifolio. Likewise with sharia screening process. criteria were applied to DJIMI.