

Pembentukan portfolio dengan menggunakan market capitalization weighted indexing equal weighted indexing dan diversity indexing pada 10 saham bernilai kapitalisasi pasar terbesar yang terdaftar di BEI periode tahun 2010 hingga 2014 = The establishment of portfolio with market capitalization weighted indexing equal weighted indexing and diversity indexing on 10 biggest market capitalization stock in BEI period 2010-2014

Novanda Rizka Aditya, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20421838&lokasi=lokal>

Abstrak

Skripsi ini membahas tentang pembentukan portfolio yang terdiri dari 10 saham yang mempunyai nilai kapitalisasi pasar terbesar dengan menggunakan metode market capitalization-weighted indexing, equal-weighted indexing, dan diversity indexing. Portfolio yang sudah dibentuk menggunakan metode tersebut, kemudian diukur kinerjanya dengan menggunakan Treynor, Sharpe, Jensen alpha, dan Information Ratio. Dari hasil penilaian kinerja dan penelitian berdasarkan portfolio yang sudah dibentuk menunjukkan metode market capitalizationweighted merupakan metode yang paling bagus untuk digunakan dalam membentuk suatu portfolio

.....This study discusses the establishment of portfolio that composed from 10 biggest market capitalization stock with market capitalization-weighted indexing, equalweighted indexing, diversity indexing. Then, the performance of portfolio measured with Treynor, Sharpe, Jensen alpa, and Information Ratio. Based on research and performance analysis, market capitalization-weighted indexing method is the best method that can be used for composing a portfolio.