

المستخلص

محمد ولدان إشدنيشة, 2015, البحث الجامعي. الموضوع: تحليل مقارنة بين المخاطر والعوائد المالية الشركات المملوكة للدولة مع الملكية الخاصة (دراسة عن LQ-45 الأرصدة في البنوك الفترة 2011-2014 القطاع)

المشرف : دكتوراندوس أجوس سوجيفطا, الماجستير
الكلمات الرئيسية: المخاطر والعائد، الشركات المملوكة للدولة أسهم، الأسهم الخاصة

في هذه الحقبة من تطور، والكثير من الخيارات البديلة للاستثمار، والتي تتراوح من الأصول الاستثمارية الحقيقية للاستثمار في سوق الأوراق المالية من الأسهم المملوكة للدولة وأسهم خاصة. ومع ذلك، فإن الخيار الرئيسي للشخص في الاستثمار هو كيف يمكن للعائد على عرض لكيفية المخاطر التي قد تحدث. القطاع المصرفي هو قطاع واحد من الأسهم القائمة في صفوف للأوراق المالية التي لديها الأداء الجيد إلى حد ما. وأسهم في LQ-45 هي عبارة عن مجموعة من الأسهم السائلة . BEI المخاطر والعائد بين الأسهم الخاصة والمملوكة للدولة هو الشيء الذي يجب أن يعرفه في المقام الأول للمستثمرين في إندونيسيا. ثم كيف المقارنة بين المخاطر والعائد بين الأسهم المملوكة للدولة لأسهم خاصة. ويمكن تحليلها عن طريق عوائد شهرية للسهم والانحراف المعياري باعتباره خطرا باستخدام اختبار T اختبار المستقلة. تؤخذ ثم الحصول على عينتين من أسهم الشركات المملوكة للدولة وعينتين أيضا من الأسهم وأسعار الأسهم الخاصة والبيانات الشهرية أيضا أرباح خلال 2011-2014. وأظهرت نتائج التحليل أن متوسط العائد الشهري من الأسهم المملوكة للدولة أكبر من الأسهم الخاصة، وكذلك الأسهم المملوكة للدولة مخاطر أكبر من حصة خاصة. في الاختبار الإحصائي باستخدام T المستقلة اختبار اختبار مع مستوى الدلالة 5% أظهرت $0.05 < 0.429$ وهو ما يعني أنه لا يوجد فرق كبير بين المخاطر والعائد من الأسهم المملوكة للدولة إلى الملكية الخاصة، بمعنى أن المخاطر والعائد بين الأسهم الخاصة والمملوكة للدولة هي نفسها.