

المستخلص

الفرمان، داني. 2013. العنوان: "في مستوى التنفيذ ريترون المتنوعة محفظة الأسهم والمخاطر. (دراسات على الشركات المدرجة في مؤشر جاكارتا الإسلامية)"
المشرف: الدكاترة. ألكوس سوسيببتو، الماجيستير
كلمات البحث: التنويع والمخاطر والمخاطر ريترون

ان مبادئ الإدارة المالية المعمول بها في ارتفاع العائد عالية المخاطر، وهو ما يعني استثمارا يوفر ارتفاع معدل العائد يقابله درجة عالية من المخاطر أيضا. ولذلك، من أجل الحد من مخاطر الاستثمار بذل الجهود لتنويع أو توزيع الثروة في مجموعة متنوعة من الأصول. تهدف هذه الدراسة إلى تحديد مستوى المخاطر وحفاظة العودة من خلال تنفيذ التنويع.

وبناء على هذه المشاكل، وتستخدم هذه الدراسة الطرق النوعية لنهج الوصفي. يتم أخذ بيانات من البيانات الخارجية الثانوي في شكل أسعار الأسهم اليومية ومؤشرات الفترة مؤشر جاكارتا الإسلامية ديسمبر 2011 ونوفمبر 2012. أساليب تحليل البيانات المستخدمة في هذا البحث أن ماركويتز المحافظ نموذج.

ذكرت الدراسة التي أجريت التنويع الناجح يخفض خطر الاصابة محفظة ينظر صغيرة نسبيا بالمقارنة مع مخاطر الأسهم الفردية، وذلك باستخدام حجم معامل الارتباط في مفهوم التنويع، حيث حجم تأثير معامل الارتباط على مخاطر المحفظة. معامل الارتباط أصغر (سلبى) بين معدل الربح، والحد من فعالية أو الحد من مستوى المخاطر، ومما يدل على محفظة من قبل مجموعة من حزب العمال.

ييو. الكروجة و ييو. يونيليفر إندونيسيا تي بي كي مع مستوى المخاطر ومعدل العائد من 0.017% و 0.199% . ييو. الكروجة ويروساهان الغاز نيجارا (شركة مسؤولية) تي بي كي مع مستوى المخاطر من 0.017% و 0.188% معدل العائد، ومحفظة هو مزيج من تركيبات اثنين مع معامل ارتباط أفضل .