

الملخص

“أريانتو، أجوس الرسالة 2013. عنوان: "مقارنة مع طراز المحفظة مؤشر الأسهم احدة بين JII مع الشريعة FTSE مؤشر الأسهم الذهب في ماليزيا سنة فترة 2010 - 2012"

Pembimbing : Ulfi Kartika Oktaviana, SE., M.Ec. Ak

Kata Kunci : JII,FBMS اوبتيما المحفظة، نموذج رقم قياسي واحد،

المستثمرين العقلاني للاستثمار أموالها في الأسهم بكفاءة، أي الأسهم التي لديها عائد مرتفع مع الحد الأدنى من المخاطر. العينات في هذه الدراسة باستخدام الصفقات الأسهم النشطة على أساس التردد وأرباح الأسهم الانقسام لمدة ثلاث سنوات متتالية. هدف البحث هو إنشاء وتحديد محفظة العائد والمخاطرة الاختلافات الأمتل بين المرشحين وغير المرشحين محفظة سهم. أظهرت النتائج أن هناك تسعة عشر سهم، نفذت من فحص مجموعة من المرشحين واحد وثلاثين الأوراق المالية. يتم تشكيل محفظة الأمتل من قبل أربعة أسهم، أي الأسهم و JII ANTM BMRT و FBMS هو DIGI وبيترونا. بلغت نسبة أربعة صناديق الأسهم إلى 41.61% و 24.72% لل ANTM و JBMRT و بيترونا 209 12% و 18.4816%. والاستنتاج هو أن المستثمر العقلاني سوف تستثمر أموالها في المحفظة المثلى تتألف من أسهم ANTM و JBMRT و JII و DIGI وبيترونا إلى FBMS. لأن كلا من الأسهم من المؤشرين يتفق على الرغم من اسهم مرشح محسوب على أساس فترات مختلفة. من نتائج اختبار الفرضيات المختلفة يمكن استنتاج أن هناك اختلافات بين المرشحين على 15 بيتا بيتا مع JII أسهم 16 سهما في محفظة المرشحين FBMS. متوسط المخزون بيتا مرشح العالي (0.953) من عودة متوسط المخزون غير مرشح (0.561). حتى يتم تشكيل محفظة الأمتل في هذه الدراسة من خلال الأسهم التي لديها أعلى رتان في المستوى النسبي نفسه من المخاطر.