خلاصة

ستين،أطروحةعام2014. العنوان: "واحدمؤشرنموذجوتطبيقالهيمنةالعشوائيةفيتحليلالمحفظةالمثلىللأرصدة (دراسةفيمؤشرجاكرتاالإسلامية(JII)فيبورصةإندونيسيا(IDX) للفترةمن2009إلى2012)."

المشرف: محمدسلانSE., MM

الكلماتالرئيسية: عودة،المخاطر،وهيمنةالعشوائية،نموذجمؤشرواحد

وينطبق هذا البحث هيمنة مباشرة العشوائية ونموذج مؤشر واحد لمشاكل التحديد حافظة حل. أما بالنسبة للغرض من هذا البحث لتحليل محفظة الاستثمار الأمثل للأسهم في بورصة إندونيسيا باستخدام نموذج مؤشر واحد وهيمنة العشوائية. وبالإضافة إلى ذلك أيضا معرفة ما إذا كان هناك فرق لاستثمارات المخاطر والعودة عن طريق استخدام الهيمنة العشوائية مقارنة باستخدام نموذج مؤشر واحد.

تستخدم هذه الدراسة البيانات الثانوية واختيار العينة هادفاً. بيانات عينة تتكون من 14 الأرصدة المحددة (من JII) المكتسبة خلال 42 شهرا، يونيو 2009 حتى تشرين الثاني/نوفمبر 2013. استخدمت اختبار t عينة مستقلة تحليل مخاطر استثمارات وإرجاع الفرق بين اختيار الأسهم باستخدام الهيمنة العشوائية مع مجموعة مختارة أسهم باستخدام نماذج فهرس واحد

استناداً إلى تحليل البيانات وعملية، الأسهم الهيمنة العشوائية قادرة على إنتاج المرشحين الإثني عشر حوافظ ونموذج مؤشر واحد قادر على إنتاج تسعة حافظة الأسهم المرشحة. وتبين النتائج التجريبية أن هناك فرقا كبيرا بين استثمارات المخاطر والأرصدة الانتخابات عودة استخدام الهيمنة العشوائية مع مجموعة مختارة أسهم باستخدام نموذج مؤشر واحد. الاستنتاجات في هذه الدراسة هو نموذج مؤشر واحد قادر على توليد المحفظة المثلى التي أفضل من المحفظة المثلى للهيمنة العشوائية.