



No Alumni Universitas

Atika Fathulrahmi

No Alumni Fakultas

BIODATA

a). Tempat/Tgl Lahir: Solok/03 Desember 1993. b). Nama Orang Tua: Abra dan Dewi Wahyuni Sari c). Fakultas: Ekonomi d). Jurusan: Akuntansi e). No Bp: 121053031 f). Tanggal Lulus: 4 April 2016. g). Predikat Lulus: Sangat Memuaskan. h). IPK: 3,45. i). Lama Studi: 3 Tahun 8 Bulan j). Alamat Orang Tua: Villa Melati Mas Blok.C No.6 Tabing, Padang.

Analisis Kinerja Pasar Saham Jakarta Islamic Index (JII) Dengan Menggunakan Model Sharpes, Jensen, dan Treynor (Periode Pengamatan pada Tahun 2004-2015)

Skripsi oleh Atika Fathulrahmi
Pembimbing Dr. Efa Yonnedi, S.E, MPPM, Ak

ABSTRACT

The purpose of this research is to analyze the stocks market performance in Jakarta Islamic Index (JII). Analysis of stock market performance is measured by using Sharpes model, Jensen and Treynor. The population in this research is the companies listed in Jakarta Islamic Index (JII) period 2004-2015. There are four companies used as sample which fulfill the criteria determination by using purposive sampling method. The observation period in this research is divided into three periods: normal period, financial crisis period and after financial crisis period. The results showed that every observation period, the performance of stock market which measured by using Jensen Model and Treynor Model is tend to be the same. The entire company's stock has lower value than market value.

Keywords: Market performance analysis, Sharpes, Jensen, Treynor, Jakarta Islamic Index (JII)

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menganalisa kinerja pasar saham-saham Jakarta Islamic Index (JII). Analisa kinerja pasar saham ini diukur dengan menggunakan model Sharpes, Jensen, dan Treynor. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan-perusahaan yang terdapat dalam Jakarta Islamic Index (JII) pada tahun 2004-2015. Metode pemilihan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling method*. Berdasarkan kriteria yang ditentukan, didapatkan jumlah sampel yang terpilihnya itu sebanyak empat perusahaan. Periode pengamatan pada penelitian ini dibagi menjadi tiga yaitu pada saat periode normal, krisis keuangan dan setelah krisis keuangan. Hasil penelitian ini menunjukkan pada setiap periode pengamatan kinerja pasar saham suatu perusahaan yang diukur dengan model Jensen dan Treynor cenderung sama, dan seluruh saham perusahaan bernilai lebih rendah dari nilai pasar.

Kata Kunci : Analisis Kinerja Pasar, Sharpes, Jensen, Treynor, Jakarta Islamic Index (JII)

