ABSTRAK

Skripsi yang berjudul "Analisis Portofolio Optimal dan Penilaian Kinerja Saham-saham Jakarta Islamic Index(JII) Periode 2010-2014" adalah penelitian kualitatif untuk menjawab pertanyaan apa saja saham-saham dalam Jakarta Islamic Index yang membentuk portofolio optimal dengan menggunakan metode indeks tunggal dan bagaimana kinerja saham-saham Jakarta Islamic Index (JII) yang telah terbentuk dalam portofolio optimal.

Data penelitian ini dihimpun melalui pembacaan dan kajian teks (*text reading*) emiten yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) selama periode 2010-2014 dengan sampel sebanyak 13 emiten. Penelitian ini menggunakan analisis kualitatif yang bersifat deskriptif representatif. Selanjutnya dianalisis dengan metode indeks tunggal, metode Sharpe, metode Treynor dan metode Jensen dengan bantuan Ms. Excel *for windows* 2007.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa ditemukan 8 saham yang bisa dibentuk menjadi portofolio optimal yaitu saham AALI, ASRI, INTP, KLBF, LPKR, SMGR, UNTR, UNVR. Kemudian kinerja saham-saham tersebut dievaluasi dengan menggunakan metode Sharpe, Treynor dan Jensen. Metode Sharpe dan Treynor menghasilkan UNVR sebagai saham dengan kinerja terbaik dengan nilai masing-masing 31% dan 5,7%. Sedangkan metode Jensen menghasilkan ASRI sebagai saham peringkat pertama dengan nilai sebesar 2,6%.

Sejalan dengan kesimpulan diatas, maka disarankan bagi investor untuk membuat portofolio yang terdiri atas saham UNVR dan ASRI sebagai pilihan utama dalam berinvestasi.

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id