

Pengaruh perspektif Islam terhadap imbal hasil saham yang diharapkan di Indonesia: studi empiris pada saham perusahaan yang terdaftar dalam indeks harga saham gabungan dan Jakarta Islamic Index di Bursa Efek Indonesia periode Januari 2012-Desember 2014 = The influence of Islamic perspective on expected stocks return in Indonesia: composite stock price index and Jakarta Islamic Index in Indonesia Stock Exchange period January 2012 December 2014

Pherinda Eka Putri, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20429846&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh perspektif Islam terhadap imbal hasil saham yang diharapkan. Penelitian ini menggunakan data panel pada metode penelitian deskriptif kuantitatif, dengan data sampel pada saham konvensional dari Indeks Harga Saham Gabungan dan saham syariah dari Jakarta Islamic Index. Teknik pengambilan sampel dilakukan dengan purposive sampling melalui metode analisis regresi model panel. Hasil penelitian menunjukkan bahwa imbal hasil pasar berpengaruh positif, ukuran berpengaruh negatif, nilai buku pasar berpengaruh positif, dan faktor risiko Islam berpengaruh negatif terhadap imbal hasil saham yang diharapkan.

This study aims to determine the influence of the Islamic perspective on expected stock returns. This study uses panel data on methods of quantitative descriptive study with a sample of the data on conventional stock from Composite Stock Price Index and Islamic stock form Jakarta Islamic Index. The sampling technique is done with purposive sampling through the regression analysis method of panel model. The result showed return market have a positive impact, size have a negative impact, book to market have a positive impact, and Islamic risk factor have a negative impact on expected stock return.