

UNIVERSITAS BINA NUSANTARA

Fakultas Ekonomi dan Komunikasi

Jurusan Akuntansi dan Keuangan

Skripsi Sarjana Strata 1 Akuntansi

Semester Genap 2014/2015

**ANALISIS KINERJA SAHAM INDIVIDUAL PADA INDUSTRI TEMBAKAU
DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE JANUARI 2012 – DESEMBER 2014****Pietro Mario David Nuah****1501184714**

Abstrak

Penelitian ini dilakukan dengan tujuan untuk menganalisis tingkat *return*, resiko, dan kinerja saham industri tembakau yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode Januari 2012 – Desember 2014. Objek penelitian ini adalah perusahaan industri tembakau yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode Januari 2012 – Desember 2014. Metode analisis yang digunakan adalah *daily return*, *geometric mean return*, standard deviasi, dan *sharpe performance index*. Hasil penelitian ini menunjukkan tingkat *return* dari yang tertinggi sampai yang terendah yaitu saham PT HM Sampoerna Tbk (0.0596%), PT Gudang Garam Tbk (-0.0033%), PT Bentoel Internasional Investama Tbk (-0.0518). Sedangkan untuk tingkat resiko dari yang terkecil sampai dengan yang terbesar yaitu saham PT HM Sampoerna Tbk (0.011), saham PT Gudang Garam Tbk (0.019), saham PT Bentoel Internasional Investama Tbk (0.026). Untuk analisis kinerja saham menghasilkan urutan *sharpe performance index* mulai dari yang terbesar sampai dengan yang terkecil yaitu saham PT HM Sampoerna Tbk (3.20%), PT Gudang Garam Tbk (-1.40%), PT Bentoel Internasional Investama Tbk (-2.94%). Kesimpulan dari penelitian ini menunjukkan bahwa perusahaan yang memiliki kinerja terbaik selama periode penelitian adalah saham PT HM Sampoerna Tbk, karena dilihat dari analisis kinerja sahamnya yaitu *sharpe performance index* sebesar 3.20%.

Kata Kunci:*Return, Geometric Mean Return, Resiko, Kinerja Saham, Sharpe Performance Index.*

UNIVERSITAS BINA NUSANTARA

Faculty of Economic and Communication

Accounting and Finance Department

Thesis of Bachelor Degree in Accounting

Even Semester 2014/2015

**ANALYSIS OF THE PERFORMANCE OF INDIVIDUAL STOCKS IN
TOBACCO INDUSTRY IN INDONESIA STOCK EXCHANGE
PERIOD JANUARY 2012 – DESEMBER 2014**

Pietro Mario David Nuah

1501184714

Abstract

This study was conducted to analyze the rate of return, risk, and performance of the tobacco industry stocks listed on Indonesia Stock Exchange period January 2012 - December 2014. The object of this study is the tobacco industry companies listed on the Indonesia Stock Exchange period January 2012 - December 2014. The analytical method used is the daily return, the geometric mean return, standard deviation, and Sharpe performance index. These results indicate that the rate of return from the highest to the lowest, PT HM Sampoerna Tbk (0.0596%), PT Gudang Garam Tbk (-0.0033%), PT Bentoel Internasional Investama Tbk (-0.0518). As for the level of risk from the smallest to the largest, PT HM Sampoerna Tbk (0.011), PT Gudang Garam Tbk (0.019), PT Bentoel Internasional Investama Tbk (0.026). To generate a sequence analysis of stock performance sharpe performance index ranging from the largest to the smallest, PT HM Sampoerna Tbk (3.20%), PT Gudang Garam Tbk (-1.40%), PT Bentoel Internasional Investama Tbk (-2.94%). Conclusion This research shows that companies that have the best performance during the study period were shares of PT HM Sampoerna Tbk, as seen from the analysis of the performance shares are sharpe performance index at 3.20%.

Keyword :

Return, Geometric Mean Return, Risk, Stock Performance, Sharpe Performance Index.

