

Peringkat kinerja untuk reksa dana tipe ekuitas di Indonesia untuk periode 2005-2010 menggunakan rasio sharpe, Treynor, dan Jensen Alpha = Performance ranking for equity type of mutual funds in Indonesia for the period of 2005 - 2010 using sharpe, treynor, and jensen alpa ratios

Andrew Halim, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20281479&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini bertujuan menganalisis kinerja reksa dana (ekuitas) yang diperdagangkan pada periode tahun 2005 sampai 2009. Hal ini dilakukan dalam rangka untuk mencari reksadana terbaik untuk periode lima tahun tersebut berdasarkan Rasio Sharpe, Treynor, dan Jensen. Hasilnya kemudian akan digunakan untuk memprediksi apakah reksadana terbaik di lima tahun tersebut masih akan menjadi yang terbaik di 2010. Tujuan dari tesis ini adalah untuk mengetahui apakah investasi masa depan dapat diprediksi (sampai tingkat tertentu) berdasarkan data historis. Sumber data yang digunakan dalam menyelesaikan tesis ini dikumpulkan dari sumber-sumber sekunder dari lembaga seperti Bank Indonesia dan Bapepam LK. Temuan penelitian ini mendukung pernyataan bahwa kinerja terbaik untuk periode lima tahun tersebut masih merupakan reksa dana terbaik untuk 2010 berdasarkan ketiga rasio tersebut.

.....This thesis is intended to analyze the performance of mutual funds (equity) that were traded in the period of 2005 to 2009. This is done in order to find the best performer for the five years period based on Sharpe, Treynor, and Jensen Ratios. The result would then be used to predict whether the best performer in the five years period would still perform best in 2010.

The purpose of this thesis is to find out whether future investments can be predicted (to some degree) based on historical data. The sources of data used in completing this thesis were collected from secondary resources posted by institutions such as Bank of Indonesia and Bapepam LK. The findings of this thesis seems to support the claim that the best performer for the five years period was still the best performer for 2010 based on the three ratios.