

Performance Evaluation of Mutual Funds: Risk-Adjusted Returns and Performance Attribution Analysis of Tata Equity PE Fund (TEPF) = Analisis Kinerja Reksa Dana: Risk-Adjusted Returns dan Atribusi Kinerja Tata Equity PE Fund (TEPF)

Kania Radityarani Latifa, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920550645&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengevaluasi kinerja Tata Equity PE Fund (TEPF) dengan menganalisis risk-adjusted returns dan atribusi kinerjanya. Penelitian ini menggunakan berbagai metrik dan model keuangan untuk menilai efisiensi dana dalam menghasilkan pengembalian relatif terhadap risikonya. Analisis mencakup pemeriksaan rinci terhadap strategi investasi, komposisi portofolio, dan kondisi pasar yang mempengaruhi kinerjanya. Dengan membandingkan kinerja TEPF dengan tolok ukur yang relevan, seperti Bombay Stock Exchange (BSE) Sensitive Index (SENSEX) dan dana ekuitas lainnya, studi ini bertujuan untuk memberikan wawasan tentang kemampuan dana untuk mencapai tujuan investasinya. Temuan ini menyoroti faktor-faktor kunci yang berkontribusi pada kinerja dana dan menawarkan rekomendasi bagi investor yang ingin mengoptimalkan portofolio investasi mereka. Penelitian ini penting untuk memahami dinamika kinerja reksa dana dalam konteks manajemen risiko dan strategi investasi.

.....The objective of this study is to evaluate the performance of the Tata Equity PE Fund (TEPF) by analyzing its risk-adjusted returns and performance attribution. This research employs various financial metrics and models to assess the fund's efficiency in generating returns relative to its risk. The analysis includes a detailed examination of the fund's investment strategy, portfolio composition, and market conditions that influenced its performance. By comparing TEPF's performance with relevant benchmarks, such as SENSEX and other equity funds, the study aims to provide insights into the fund's ability to achieve its investment objectives. The findings highlight the key factors that contributed to the fund's performance and offer recommendations for investors seeking to optimize their investment portfolios. This research is significant for understanding the dynamics of mutual fund performance in the context of risk management and investment strategies.