

Application of Return-Based Measures in Evaluating Investment Companies Portfolio Performance: A Case Study of Tata Equity P/E Mutual Fund (TEPF) = Aplikasi Tolak Ukur Berbasis Return dalam Evaluasi Performa Portofolio Perusahaan Investasi: Studi Kasus Tata Equity P/E Mutual Fund (TEPF)

Tanjung, Sabrina Nurcahya, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920550871&lokasi=lokal>

Abstrak

Tugas akhir ini berdasarkan salah satu tugas dalam mata kuliah “Investments” di University of Melbourne. Tulisan akademis ini membahas cara mengaplikasikan metode Tolak Ukur Investasi Berbasis Return sebagai suatu cara estimasi untuk mengevaluasi performa portofolio dari perusahaan investasi. Tulisan akademis ini mengangkat studi kasus perusahaan reksa dana Tata Mutual Fund yang meluncurkan “Tata P/E Equity Mutual Fund” (TEPF) sebagai portofolio subjek untuk dibandingkan dengan benchmark yang telah ditentukan, yaitu Bombay Stock Exchange Sensitive Index (BSE SENSEX). Hasil yang didapatkan dari studi kasus ini adalah untuk melihat apakah performa TEPF telah melampaui portfolio benchmark dilihat dari beberapa metode perhitungan yang akhirnya dapat memengaruhi keputusan para investor dalam menentukan kebijakan investasi mereka.This Academic Paper is based on one of the assignments in the subject “Investments” in University of Melbourne. This writing will provide an example of how to implement Return- Based Measures formulas as an estimation in the evaluation of an investment company’s’ performance using applicable assumptions. This writing uses a case study of Tata Equity P/E Mutual Fund (TEPF), launched by the company Tata Mutual Fund, as a subject portfolio to be compared with its chosen benchmark, Bombay Stock Exchange Sensitive Index (BSE SENSEX). The result from this case study is to find out whether TEPF outperformed its benchmark based on some measures which later can affect the decision on investing in the portfolio or not from the investors’ point of view.