

Analisis atas faktor dana kelolaan biaya manajemen terhadap risiko reksa dana saham = An analysis of asset under management and management fee on stock mutual fund risk / Diego Octaria

Diego Octaria, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20350193&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Telah banyak penelitian dilakukan untuk melihat faktor apa saja yang mempengaruhi risiko dari reksa dana. Penelitian dalam tesis ini melihat apakah ada hubungan antara biaya manajemen dan dana kelolaan terhadap risiko reksa dana saham yang ada di Indonesia. Data yang digunakan adalah data harian nilai aktiva bersih per unit dari semua reksa dana saham di Indonesia serta data total dana kelolaan dan biaya manajemen dari masing-masing reksa dana untuk periode bulan Januari 2010 hingga bulan Desember 2012. Untuk menilai risiko dari masing-masing reksa dana digunakan volatilitas menggunakan metode EWMA. Hasil yang didapatkan bahwa dana kelolaan dan biaya manajemen tidak berpengaruh terhadap risiko dari reksa dana saham di Indonesia.

<hr>

ABSTRACT

There have been many studies done to see what factors affect the risk of mutual funds in many countries. Research within thesis to see whether there is a relationship between cost of management and funds under management against risk of stock mutual funds who exist in Indonesian. The data which used is the daily data asset value net per unit of all mutual fund shares of in Indonesia as well as the data total asset under management and management fee respectively for the the period of month of January 2010 until month of in December 2012. To assess the risk of each fund is used volatility using EWMA. The results showed that the funds under management and management fees do not have a significant relationship to the risk of stock mutual funds in Indonesia.