

Analisis Pengukuran Kinerja Reksa Dana Saham di Indonesia Tahun 2008 - 2012 = Analysis on The Measurement of Mutual Fund Performance in Indonesia during 2008 - 2012

Pandu Adi Laras, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920534930&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini mengukur kinerja dana saham di Indonesia pada kurun waktu Januari 2008 sampai Oktober 2012 dengan menggunakan Sharpe Ratio, Treynor Ratio, Henriksson Merton Model, dan Snail Trail. Hal baru yang ingin ditemukan oleh penulis adalah adanya persistensi kinerja selama waktu penelitian, namun persistensi tidak ditemukan senada dengan tidak adanya kemampuan market timing di Indonesia. Namun kinerja reksa dana saham selama periode penelitian menunjukkan adanya beberapa reksa dana yang konsisten memiliki kinerja sangat baik pada satu atau beberapa potongan periode penelitian.

.....This thesis measures mutual fund performance in Indonesia during the period of January 2008 to October 2012 using the Sharpe Ratio, Treynor Ratio, Henriksson Merton model, and Snail Trail. Author aimed to show persistence of performance during the study period, but this is not the case. This also align with the absence of market timing ability in Indonesia. But the performance of equity mutual funds during the period of the study revealed a number of mutual funds that consistently have a superior performance on one or more fragment of the study period.