

Evaluasi Performa Risk Adjusted Return Pada Dana Investasi Saham Onshore Prudential Indonesia = Evaluation of Risk-Adjusted Return Performance of Prudential Indonesia Onshore Stock Investment Funds

Abdillah Rifai, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920548233&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk memahami penerapan teori yang dipelajari selama menjadi mahasiswa Manajemen Keuangan di Fakultas Ekonomi dan Bisnis, khususnya teori risk adjusted return yang berkaitan dengan mata kuliah Manajemen Investasi dalam konteks perusahaan asuransi yang berperan penting dalam pengelolaan dana investasi. Kegiatan investasi yang diteliti meliputi alokasi aset investasi, pencatatan transaksi, dan perhitungan performa dana investasi selama periode 2017 hingga 2024 ytd dengan indikator risk-adjusted return sebagai fokus utama. Metode analisis deskriptif digunakan untuk menggambarkan data dan informasi secara sistematis, memberikan gambaran menyeluruh tentang proses investasi di perusahaan asuransi. Hasil penelitian menunjukkan bahwa kegiatan investasi belum optimal karena masih ada proses manual pada beberapa bagian pelaporan dan performa dana yang berfluktuasi selama beberapa tahun terakhir dari semua indikator risk-adjusted return yang secara umum menggambarkan performa manajer investasi yang tidak mampu menghasilkan imbal hasil yang memuaskan dan pengelolaan risiko yang belum cukup baik. Temuan ini menyoroti meningkatkan efisiensi dan efektivitas proses pelaporan kegiatan investasi dengan mengurangi proses manual yang sangat. pemilihan indikator evaluasi kinerja yang tepat sesuai kondisi pasar dan karakteristik dana, serta memberikan wawasan praktis bagi berbagai pemangku kepentingan untuk memahami imbal hasil dana investasi secara komprehensif.

..... This study aims to understand the application of theories learned as a Finance Management student at the Faculty of Economics and Business, specifically risk-adjusted return theories related to Investment Management courses, in the context of insurance companies, which play a significant role in investment fund management. The investment activities investigated include asset allocation, transaction recording, and performance calculation of investment funds from 2017 to 2024 YTD, with a primary focus on risk-adjusted return indicators. A descriptive analysis method was used to systematically depict data and information, providing a comprehensive overview of the investment process in insurance companies. The results indicate that investment activities are not yet optimal due to the presence of manual processes in some reporting sections and fluctuating fund performance over the past few years. All riskadjusted return indicators generally illustrate that investment managers have not been able to generate satisfactory returns and have not adequately managed risk. These findings highlight the need to enhance the efficiency and effectiveness of investment activity reporting by reducing manual processes, selecting appropriate performance evaluation indicators according to market conditions and fund characteristics, and providing practical insights for various stakeholders in understanding investment fund returns more comprehensively.