

SKRIPSI

**ANALISIS PENGUKURAN KINERJA REKSA DANA SAHAM
MENGUNAKAN METODE *SHARPE RATIO*, *TREYNOR
RATIO*, DAN *JENSEN'S ALPHA* PADA TAHUN 2018**



DIAJUKAN OLEH:

NAMA: LEONARDO HANSMARCO

NIM: 115160384

**UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT-SYARAT
GUNA MENCAPAI GELAR SARJANA EKONOMI**

PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

JAKARTA

2020

UNIVERSITAS TARUMANAGARA
FAKULTAS EKONOMI
JAKARTA

ABSTRAK

- (A) LEONARDO HANSMARCO
- (B) ANALISIS PENGUKURAN KINERJA REKSA DANA SAHAM
MENGUNAKAN METODE SHARPE RATIO, TREYNOR RATIO,
DAN JENSEN'S ALPHA
- (C) xvii + 103 halaman, 5 tabel, 2 gambar, 28 lampiran
- (D) MANAJEMEN KEUANGAN
- (E) **Abstrak:** Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui kinerja reksa dana saham tahun 2018 dengan metode *Sharpe Ratio*, *Treynor Ratio*, dan *Jensen's Alpha*. Sampel yang diteliti adalah 65 reksa dana saham yang dipilih dengan teknik *purposive sampling*. Hasil penelitian ini menunjukkan terdapat 14 reksa dana saham menunjukkan kinerja yang positif dan 51 reksa dana saham menunjukkan kinerja negatif pada tahun 2018 berdasarkan perhitungan menggunakan metode *Sharpe Ratio*; terdapat 12 reksa dana saham menunjukkan kinerja yang positif dan 53 reksa dana saham menunjukkan kinerja negatif pada tahun 2018 berdasarkan perhitungan menggunakan *Treynor Ratio*; terdapat 30 reksa dana saham menunjukkan kinerja yang positif dan 35 reksa dana saham menunjukkan kinerja negatif pada tahun 2018 berdasarkan perhitungan menggunakan *Jensen's Alpha*.
- (F) Kata kunci: kinerja reksa dana saham, *Sharpe Ratio*, *Treynor Ratio*, *Jensen's Alpha*
- (G) Daftar acuan 22 (1997-2019)
- (H) Dra. Yusbardini M.M.

UNIVERSITAS TARUMANAGARA
FAKULTAS EKONOMI
JAKARTA

ABSTRACT

- (A) LEONARDO HANSMARCO
- (B) ANALYSIS OF EQUITY FUNDS PERFORMANCE WITH SHARPE RATIO, TREYNOR RATIO, AND JENSEN'S ALPHA METHOD
- (C) xvii + 103 pages, 5 tables, 2 pictures, 28 attachments
- (D) FINANCIAL MANAGEMENT
- (E) *Abstract: The purpose of this study was to determine the performance of mutual fund shares in 2018 using the Sharpe Ratio, Treynor Ratio, and Jensen's Alpha methods. Sample was selected by purposive sampling technique amounted to 65 equity funds. The results of this study indicate there are 14 equity funds showing positive performance and 51 equity funds showing negative performance in 2018 based on calculations using the Sharpe Ratio method; there are 12 equity funds showing a positive performance and 53 equity funds showing a negative performance in 2018 based on calculations using the Treynor Ratio; there are 30 equity funds showing a positive performance and 35 equity funds showing a negative performance in 2018 based on calculations using Jensen's Alpha.*
- (F) *Keywords: performance of equity fund, Sharpe Ratio, Treynor Ratio, Jensen's Alpha*
- (G) 22 references (1997-2019)
- (H) Dra. Yusbardini M.M.