

PENGUKURAN KINERJA REKSA DANA PENDAPATAN TETAP DENGAN MENGGUNAKAN METODE SHARPE PERIODE JULI 2006 DESEMBER 2008 (STUDI KASUS PADA PT FORTIS INVESTMENTS)

Tommy Christianto Wibisono, Haryono, SE , MMSi

Penulisan Ilmiah, Fakultas Ekonomi, 2009

Universitas Gunadarma

<http://www.gunadarma.ac.id>

kata kunci : reksa dana

Abstraksi :

Pengukuran kinerja menggunakan metode sharpe adalah salah satu pengukuran kinerja reksa dana dengan memasukkan unsur risiko di dalamnya berupa risiko fluktuasi (standard deviasi). Objek penelitian adalah PT Fortis Investments. Data yang digunakan adalah daftar Total NAB dan Total Unit Reksa Dana Fortis Prima dan Fortis Rupiah Plus selama periode Juni06-Desember08 yang diperoleh dari PT Fortis Investments, serta daftar suku bunga SBI periode Juni06-Desember08 yang diperoleh dari internet. Tujuan dari penelitian ini adalah melakukan perhitungan kinerja reksa dana Fortis Prima dan Fortis Rupiah Plus dengan menggunakan metode sharpe, dan membandingkan kinerja reksa dana Fortis Prima dan Fortis Rupiah Plus dengan melakukan pemeringkatan untuk mengevaluasi kinerja kedua reksa dana tersebut. Dari hasil perhitungan dan analisis dapat disimpulkan bahwa kinerja reksa dana Fortis Prima selama periode Juli06-Desember06 yaitu sebesar 5,50775, periode Januari07-Desember07 yaitu sebesar 1,08356, dan periode Januari08-Desember08 yaitu sebesar -0,67577. Dan kinerja reksa dana Fortis Rupiah Plus selama periode Juni06-Desember06 yaitu sebesar 39,90698, periode Januari07-Desember07 yaitu sebesar 0,61088, dan periode Januari08-Desember08 yaitu sebesar -0,59038. Berdasarkan pemeringkatan yang dilakukan menggunakan metode sharpe maka bila kedua reksa dana Fortis Prima dan Fortis Rupiah Plus dibandingkan, maka reksa dana Fortis Rupiah Plus menempati posisi teratas pada periode Juli06-Desember06 dan pada periode Januari08-Desember08, sedangkan reksa dana Fortis Prima menempati posisi teratas pada periode Januari07-Desember07.