

ABSTRACT

The purpose of his research are to know, describe and analyze the performance of comparison between conventional mutual fund and sharia mutual fund for investor's investment decision based on Sharpe, Treynor, Jensen and growth of AUM (Asset Under Management). The object for this research is conventional share mutual fund, sharia share mutual fund, conventional fixed income mutual funds and sharia fixed income mutual funds. This research uses Nav data (Net Asset Value) from 2015 until 2017 with sample number 52 mutual fund which have been selected by Purposive Sampling method. This research uses the data analysis is statistical analysis in the form of average difference test using independent sample t-test method.

The result of this research is no difference in analysis conventional mutual fund and Shariah mutual fund performance using Sharpe method and AUM (Asset Under Management) and have differences in analysis conventional mutual fund and Shariah mutual fund using Treynor and Jensen method.

Keywords : Mutual fund, Sharpe Method, Treynor Method, Jensen Method, Growth Method of AUM.

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

ABSTRAK

Penelitian ini untuk mengetahui, mendeskripsikan dan menganalisis kinerja reksadana konvensional dan reksadana syariah untuk keputusan investasi investor dengan menggunakan metode Sharpe, Treynor, Jensen, dan Pertumbuhan AUM (*Asset Under Management*). Objek penelitian ini adalah reksadana saham konvensional, reksadana saham syariah, reksadana pendapatan tetap konvensional dan reksadana pendapatan tetap syariah. Penelitian ini menggunakan data NAB (Nilai Aktiva Bersih) dari 2015 hingga 2017 dengan jumlah sampel 52 reksadana yang sudah dipilih dengan metode *Purposive Sampling*. Penelitian ini menggunakan analisis data yang digunakan adalah analisis statistik dalam bentuk uji beda rata-rata dengan menggunakan metode *independent sample t-test*.

Hasil penelitian ini tidak terdapat perbedaan dalam analisis kinerja reksadana konvensional dan reksadana syariah dengan metode Sharpe dan Pertumbuhan AUM (*Asset Under Management*) dan terdapat perbedaan dalam analisis kinerja reksadana konvensional dan reksadana syariah dengan metode Treynor dan metode Jensen.

Kata kunci : Reksadana, Metode Sharpe, Metode Treynor, Metode Jensen ,
Metode Pertumbuhan AUM



UNIVERSITAS
MERCU BUANA