

ABSTRACT

This study aims to determine the mutual fund shares which has the good performance by using the Jansen methods, Sharpe and Treynor and to determine whether there are differences in measurement results between the performance of mutual fund shares Jansen methods, methods of Sharpe and Treynor method. Mutual fund shares is one type of mutual fund.

There are 10 mutual fund shares used as the sample. The sampling method used is purposive sampling technique. This research use descriptive qualitative approach. The type of data used in this study using secondary data, in the form of Return Mutual Fund Shares, NAV, JCI, SBI interest rate in the form of monthly from 2015-2017. In this study used methods of Jansen , Sharpe and Treynor.

Results of analysis using methods Jansen, Sharpe and Treynor method showed that Mutual fund shares which has the best performance that HPAM Ultima Ekuitas Mutual fund And of the three methods used have different performance results.

Keywords: Mutual Funds, Jansen Method, Sharpe Method, Treynor Method



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui reksa dana saham manakah yang memiliki kinerja yang baik dengan menggunakan metode Jansen, Sharpe dan Treynor dan untuk mengetahui apakah terdapat perbedaan hasil pengukuran kinerja reksa dana saham antara metode Jansen, metode Sharpe dan metode Treynor. Reksa dana saham merupakan salah satu jenis dari reksa dana.

Terdapat 10 reksa dana saham yang digunakan sebagai sampel dalam penelitian ini. Metode pengambilan sampel yang digunakan adalah teknik *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan pendekatan deskriptif kualitatif. Jenis Data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan data sekunder, berupa data *Return* Reksa Dana saham, NAB, IHSG, suku bunga SBI dalam bentuk bulanan dari tahun 2015-2017. Penelitian ini menggunakan metode Jansen, Sharpe dan Treynor.

Hasil analisis menggunakan metode Jansen, Sharpe dan metode Treynor menunjukkan hasil bahwa Reksa Dana Saham yang mempunyai kinerja paling baik pada tahun 2015-2017 adalah Reksa Dana HPAM Ultima Ekuitas. Dan dari ketiga metode yang digunakan memiliki perbedaan hasil kinerja.

Kata Kunci : Reksa Dana, Metode Jansen, Metode Sharpe, Metode Treynor

