

ABSTRACT

ANALYSIS MEASUREMENT OF PERFORMANCE SYARIAH MUTUAL FUND BASED ON A SHARPE, TREYNOR AND JENSEN METHOD (Category Fixed Income Mutual Fund in 2014)

By

GHOIBI

This study aims to determine the performance of fixed income syariah mutual funds positive. The kind of research is descriptive namely one intended to make description, an illustration or painting systematically, factual and accurate concerning the facts, the traits and relationship between the phenomenon investigated. The research is using secondary data, obtained from the website www.ojk.go.id and www.kontan.co.id, technique data analysis was using Sharpe method, Treynor method and Jensen method.

The results showed that using Sharpe method there are two mutual fund performing good is SAM Sukuk Syariah Sejahtera and Mega Dana Obligasi Syariah. With Treynor and Jensen method there are five mutual fund performing superior that is Sam Sukuk Syariah Sejahtera

Key words: Mutual fund Performance, Sharpe, Treynor and Jensen Method

ABSTRAK

ANALISIS PENGUKURAN KINERJA REKSA DANA SYARIAH BERDASARKAN METODE *SHARPE*, *TREYNOR* DAN *JENSEN* (Kategori Reksa Dana Pendapatan Tetap Tahun 2014)

Oleh

GHOIBI

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui kinerja reksa dana syariah pendapatan tetap yang positif. Jenis penelitian yang digunakan adalah penelitian deskriptif yaitu penelitian yang ditujukan untuk membuat deskripsi, gambaran atau lukisan secara sistematis, faktual dan akurat mengenai fakta-fakta, sifat-sifat serta hubungan antar fenomena yang diselidiki. Data yang digunakan adalah data sekunder, yang diperoleh dari situs www.ojk.go.id dan www.kontan.co.id, teknik analisis yang digunakan adalah menggunakan metode Sharpe, metode Treynor dan metode Jensen.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa dengan menggunakan metode Sharpe terdapat dua reksa dana yang berkinerja baik yaitu reksa dana SAM Sukuk Syariah Sejahtera dan Mega Dana Obligasi Syariah. Dengan metode Treynor dan Jensen terdapat lima reksa dana yang berkinerja superior yaitu SAM Sukuk Syariah Sejahtera, Mandiri Investa Dana Syariah, MNC Dana Syariah, BNI Dana Syariah, dan PNM Amanah Syariah.

Kata kunci : kinerja reksa dana, metode sharpe, treynor, jensen