

DAFTAR ISI

Lembar judul.....	i
Lembar pengesahan.....	ii
Lembar pernyataan.....	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar isi.....	vi
Daftar Tabel.....	ix
Daftar Lampiran.....	xi
Intisari.....	xii
<i>Abstract</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Batasan Penelitian.....	5
1.6 Sistematika Penulisan	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1 Reksa Dana	8
2.1.1 Pengertian dan Sejarah Reksa Dana	8
2.1.2 Jenis-jenis Reksa Dana	9

2.1.3	Keuntungan dan Risiko Investasi Reksa Dana	14
2.1.4	Kinerja Reksa Dana	17
2.2	Pengukuran Kinerja Portofolio	21
2.3	Tinjauan Studi Sebelumnya	22
BAB III METODE PENELITIAN.....		24
3.1	Data dan Sampel	24
3.2	Definisi Operasional	27
3.3	Metode Evaluasi Kinerja dan Pengujian	31
3.3.1	Metode Evaluasi Kinerja	31
3.3.2	Metode Pengujian Konsistensi (<i>Kendall's Coefficient Of Concordance</i>)	36
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		38
4.1	Kinerja Reksa Dana Saham	38
4.2	Kinerja Metode Reksa Dana Saham	42
4.2.1	Kinerja Reksa Dana Saham Berdasakan <i>Sharpe Ratio</i>	42
4.2.2	Kinerja Reksa Dana Saham Berdasarkan <i>Treynor Index</i>	45
4.2.3	Kinerja Reksa Dana Saham Berdasakan <i>Jensen's Alpha</i>	49

4.3	Pengujian Konsistensi	57
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		59
5.1	Kesimpulan	59
5.2	Saran	60
Daftar Pustaka.....		62
Lampiran		64

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1	Daftar Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 sampai Agustus 2015.....	25
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif <i>Return</i> Reksa Dana Saham dan IHSG periode Januari 2009 sampai Agustus 2015.....	38
Tabel 4.2	Rata-rata <i>Return</i> Reksa Dana Saham dan Pasar Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015.....	40
Tabel 4.3	Ranking Rata-rata <i>Return</i> Reksa Dana Saham dan Pasar Periode Januari 2009 sampai Agustus 2015.....	41
Tabel 4.4	<i>Sharpe Ratio</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015.....	42
Tabel 4.5	Ranking <i>Sharpe Ratio</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015.....	44
Tabel 4.6	<i>Treynor Index</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015.....	45
Tabel 4.7	Ranking <i>Treynor Index</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015	47
Tabel 4.8	<i>Jensen's Alpha</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015.....	49

Tabel 4.9	Ranking <i>Jensen's Alpha</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 s/d Agustus 2015.....	51
Tabel 4.10	Sharpe Ratio, Treynor Index & <i>Jensen's Alpha</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 sampai Agustus 2015.....	52
Tabel 4.11	Ranking <i>Sharpe Ratio</i> , Treynor Index & <i>Jensen's Alpha</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 sampai Agustus 2015.....	55
Tabel 4.12	Hasil Uji Statistik <i>Kendall's W Test</i> Metode <i>Sharpe Ratio</i> , Treynor Index & <i>Jensen's Alpha</i> pada Reksa Dana Saham Periode Januari s/d Agustus 2015.....	57

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 sampai Desember 2009.....	64
Lampiran 2	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2010 sampai Desember 2010.....	67
Lampiran 3	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2011 sampai Desember 2011.....	70
Lampiran 4	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2012 sampai Desember 2012.....	73
Lampiran 5	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2013 sampai Desember 2013.....	76
Lampiran 6	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2014 sampai Desember 2014.....	79
Lampiran 7	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2015 sampai Agustus 2015.....	82
Lampiran 8	Kinerja Reksa Dana Saham Periode Januari 2009 sampai Agustus 2015.....	85
Lampiran 9	Uji Statistik Konsistensi Kinerja Reksa Dana Saham	87