

ABSTRAK

Savitri, Aliffatul Afdillah. 2020. Skripsi. **Analisis Metode Indeks *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen* Untuk Menilai Kinerja Portofolio Saham Yang Tergabung Dalam Jakarta *Islamic* Indeks (JII) di Bursa Efek Indonesia (BEI)**. Program Studi Akuntansi, Fakultas Ekonomi, Universitas Panca Marga.

Penelitian ini mengevaluasi Kinerja Portofolio Saham dengan menggunakan metode *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen*. Tujuannya adalah mengetahui Kinerja saham dari ke 19 sampel saham yang tergabung dalam Jakarta Islamic Indeks (JII) di Bursa Efek Indonesia (BEI) .

Jenis penelitian yang digunakan adalah penelitian kuantitatif dengan menggunakan metode komparatif untuk membandingkan variabel satu dengan variabel yang lain. Rancangan analisis ini menggunakan data sekunder berupa data harga saham, Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), dan Sertifikat Bank Indonesia periode desember 2016 – mei 2019. Hasil penelitian menunjukkan bahwa Rata-rata indeks dari ke 19 saham *Jensen* dan *Treynor* menunjukkan hasil positif. Dari ketiga metode tersebut yang menunjukkan hasil terbaik adalah metode *Jensen*.

Kata Kunci : **Indeks *Sharpe*, *Treynor*, *Jensen*, Saham BEI**.

ABSTRACT

*Savitri, Aliffatul Afdillah. 2020. Essay. **Sharpe, Treynor, and Jensen Index Method Analysis to Assess the Portfolio Performance of Shares Incorporated in the Jakarta Islamic Index (JII) on the Indonesia Stock Exchange (BEI)**. Accounting Study Program, Faculty of Economics, Panca Marga University.*

This study evaluates the performance of the stock portfolio using the Sharpe, Treynor, and Jensen methods. The goal is to determine the stock performance of the 19 stock samples that are included in the Jakarta Islamic Index (JII) on the Indonesia Stock Exchange (BEI).

This type of research is quantitative research using a comparative method to compare one variable with another. The design of this analysis uses secondary data in the form of stock price data, Composite Stock Price Index (IHSG), and Bank Indonesia Certificates for the period of December 2016 - May 2019. The results show that the average index of the 19 Jensen and Treynor stocks shows positive results. Of the three methods that show the best results is the Jensen method.

Keywords: *Sharpe Index, Treynor, Jensen, IDX Stocks.*