

ABSTRAK

Nurhalida Abubakar, 2023. Analisis Kinerja Portofolio Dengan Menggunakan Metode Indeks *Sharpe*, *Treynor*, Dan *Jensen* Pada Saham Yang Terdaftar Dalam Indeks Kompas 100 Tahun 2020-2022. Ketua Komisi: Gregorius Jeandry, Anggota Komisi: Rena Mustari Mokoginta.

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui perbedaan penilaian kinerja portofolio antara metode indeks *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen* pada saham-saham Kompas 100. Metode pengumpulan data menggunakan *purposive sampling*. Total sampel penelitian adalah sebanyak 54 saham perusahaan Kompas 100 yang terdaftar di BEI tahun 2020-2022. Alat pengujian yang digunakan adalah uji *Kruskal Wallish* dengan menggunakan SPSS. Hasil penelitian mendapatkan probabilitas 0,254 yang artinya lebih dari 0,05 sehingga menunjukkan bahwa tidak adanya perbedaan signifikan pada penilaian kinerja portofolio dengan menggunakan metode indeks *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen*.

Kata Kunci: Kinerja Portofolio, Indeks *Sharpe*, Indeks *Treynor*, Indeks *Jensen*



ABSTRACT

Nurhalida Abubakar, 2023. *Portfolio performance analysis using the Sharpe, Treynor and Jensen index methods on shares listed in the Kompas 100 index for 2020-2022, chairman of the commission: Gregorius Jeandry, member of the Commission: Rena Mustari Mokoginta.*

The aim of this research is to find out the differences in portfolio performance assessment between the Sharpe, Treynor, and Jensen index methods on 100-compas shares. Data collection method using purposive sampling. The total sample of the research was as much as 54 shares of 100 compass companies listed in the BEI in 2020-2022. The test tool used is the Wallish cruscal test using SPSS. The results of the study obtained a probability of 0,254 meaning > 0.05 until it showed that there was no significant difference in portfolio performance assessment using the Sharpe, Treynor, and Jensen index methods.

Keywords: Portofolio Performance, Sharpe Index, Treynor Index, Jensen Index

