

## ***ABSTRACT***

### ***Analysis of Stock Portofolio Performance Using Sharpe, Treynor, and Jensen Methods***

*(Case Study on The IDX80 on The Indonesian Stock Excgange in 2021 – 2023)*

*By:*

**Thariq Najmi Octaviantoro**

*NPM 203402144*

*Guide I : Dewi Permata Sari*

*Guide II : Vivi Indah Bintari*

*This research is motivated by the performance of IDX80 whose stock portfolio movements tend to be more attractive than the Indonesian Composite Stock Price Index. To evaluate the performance of the IDX80 portfolio, the Sharpe, Treynor, and Jensen methods are used. This study aims to determine whether there is a difference between the three methods. The method used is descriptive quantitative with data collection techniques through documentation studies and sample retrieval using purposive random sampling. The data analysis technique used is the Kruskal-Wallis Test with data that has been transformed using Z-score. These results indicate that there is no significant difference between testing with the Sharpe, Treynor and Jensen methods.*

***Keywords: sharpe method, treynor method, jensen method, stock portfolio performance***

## ABSTRAK

### **Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Menggunakan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen**

(Studi Kasus Pada Indeks IDX80 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2021 - 2023)

Oleh:

**Thariq Najmi Octaviantoro**

NPM 203402144

Pembimbing I : Dewi Permata Sari

Pembimbing II : Vivi Indah Bintari

Penelitian ini dilatarbelakangi oleh kinerja IDX80 yang pergerakan portofolio sahamnya cenderung lebih menarik dibandingkan dengan Indeks Harga Saham Gabungan Indonesia. Untuk mengevaluasi kinerja portofolio IDX80, digunakan metode Sharpe, Treynor, dan Jensen. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui ada tidaknya perbedaan antara ketiga metode tersebut. Metode yang digunakan adalah deskriptif kuantitatif dengan teknik pengumpulan data melalui studi dokumentasi dan penarikan sampel menggunakan purposive random sampling. Teknik analisis data yang digunakan adalah Uji Kruskal-Wallis dengan data yang telah ditransformasi menggunakan Z-score. Hasil ini menunjukkan bahwa tidak adanya perbedaan yang signifikan antara pengujian dengan Metode Sharpe, Treynor dan Jensen

**Kata Kunci: metode sharpe, metode treynor, metode jensen, evaluasi kinerja portofolio**