

## DAFTAR ISI

<b>LEMBAR PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....</b>	<b>ii</b>
<b><i>ABSTRACT</i> .....</b>	<b>iii</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>v</b>
<b>DAFTAR ISI .....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Identifikasi Masalah.....	8
1.3. Tujuan Penelitian .....	9
1.4. Kegunaan Hasil Penelitian.....	9
1.4.1. Kegunaan Pengembangan Ilmu.....	9
1.4.2. Kegunaan Praktis.....	10
1.5. Lokasi dan Waktu Penelitian.....	10
1.5.1. Lokasi Penelitian .....	10
1.5.2. Jadwal Penelitian.....	10
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS</b> <b>.....</b>	<b>11</b>
2.1. Tinjauan Pustaka .....	11
2.1.1. Pengertian Investasi Dalam Bentuk Saham .....	11
2.1.2. Teori Portofolio .....	16
2.1.3. Kinerja Portofolio.....	18
2.1.4. Metode Sharpe.....	26
2.1.5. Metode Treynor.....	27
2.1.6. Metode Jensen .....	28

2.2. Penelitian Terdahulu.....	29
2.3. Kerangka Pemikiran.....	41
2.4. Hipotesis .....	45
<b>BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN .....</b>	<b>46</b>
3.1. Objek Penelitian.....	46
3.2. Metode Penelitian .....	46
3.2.1. Jenis Penelitian.....	47
3.2.2. Operasionalisasi Variabel.....	47
3.2.2.1. Teknik Pengambilan Data.....	49
3.2.2.2. Jenis dan Sumber Data.....	49
3.2.2.3. Populasi Sasaran .....	50
3.2.2.4. Penentuan Sampel.....	50
3.2.3. Model Penelitian .....	51
3.2.4. Teknik Analisis Data.....	52
3.2.4.1. Perbandingan Kinerja Menggunakan Uji Statistik .....	54
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>57</b>
4.1. Hasil Penelitian .....	57
4.1.1. Deskripsi Data Penelitian .....	57
4.1.2. Analisis Data .....	58
4.1.2.1. Perhitungan Menggunakan Metode Sharpe.....	58
4.1.2.2. Perhitungan Menggunakan Metode Treynor .....	60
4.1.2.3. Perhitungan Menggunakan Metode Jensen .....	63
4.1.2.4. Standarisasi Data Menggunakan Z-score .....	65
4.1.2.5. Uji Kruskal Wallist .....	67
4.2. Pembahasan.....	68
4.2.1. Analisis Kinerja Portofolio Saham IDX80 Menggunakan Metode Sharpe .....	68
4.2.2. Analisis Kinerja Portofolio Saham IDX80 Menggunakan Metode Treynor .....	71

4.2.3. Analisis Kinerja Portofolio Saham IDX80 Menggunakan Metode Jensen .....	74
4.2.4. Analisis Perbandingan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen .....	76
<b>BAB V SIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>79</b>
5.1. Simpulan .....	79
5.2. Saran .....	81
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>83</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>85</b>
<b>BIODATA PENULIS.....</b>	<b>116</b>

## DAFTAR TABEL

No.	Judul	Halaman
2.1	Penelitian Terdahulu.....	30
3.1	Operasional Variabel.....	48
3.2	Pemilihan Perusahaan Sebagai Sampel.....	51
4.1	Hasil Perhitungan IDX80 Menggunakan Metode Sharpe.....	59
4.2	Hasil Perhitungan IDX80 Menggunakan Metode Treynor.....	61
4.3	Hasil Perhitungan IDX80 Menggunakan Metode Jensen.....	64
4.4	Hasil Standarisasi Menggunaka Z-score (NPar Tests).....	66
4.5	Hasil Uji Kruskal Wallist.....	67
4.6	Perbandingan <i>Mean Rank</i> Ketiga Metode.....	68

## DAFTAR GAMBAR

No.	Judul	Halaman
1.1	Imbal Hasil Tahunan.....	4
1.2	Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan.....	5
1.3	Pergerakan Indeks IDX80.....	6
3.1	Model Penelitian.....	52

## DAFTAR LAMPIRAN

No.	Judul	Halaman
1	Rencana Jadwal Penelitian.....	85
2	Populasi Saham IDX80 Tahun 2021-2023.....	86
3	Daftar Saham Pengambilan Sampel.....	90
4	Harga Saham Perusahaan yang dijadikan Sampel dan IHSG....	92
5	Suku Bunga Bank Indonesia.....	94
6	<i>Return</i> , Standar Deviasi, Beta, dan BI Rate Tahunan.....	96
7	Hasil Perhitungan Metode Sharpe.....	100
8	Hasil Perhitungan Metode Treynor.....	102
9	Hasil Perhitungan Metode Jensen.....	108
10	Hasil Sharpe, Treynor, dan Jensen Sesudah Transformasi Z-score	112