

DAFTAR ISI

PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRACT	vii
ABSTRAK	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR SIMBOL	xiii
DAFTAR SINGKATAN	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Identifikasi Masalah	10
1.3. Tujuan Penelitian	11
1.4. Kegunaan Hasil Penelitian	11
1.5. Lokasi dan Waktu Penelitian	12
1.5.1 Lokasi Penelitian	12
1.5.2 Waktu Penelitian	13
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	14
2.1. Tinjauan Pustaka	14
2.1.1. Kinerja Portofolio	14
2.1.2. Metode <i>Sharpe</i>	16
2.1.2.1 Pengertian Metode <i>Sharpe</i>	16
2.1.2.2 Cara Perhitungan Metode <i>Sharpe</i>	17
2.1.3. Metode <i>Treynor</i>	18
2.1.3.1 Pengertian Metode <i>Treynor</i>	18
2.1.3.2 Cara Perhitungan Metode <i>Treynor</i>	19
2.1.4. Metode <i>Jensen</i>	20
2.1.4.1 Pengertian Metode <i>Jensen</i>	20
2.1.4.2 Cara Perhitungan Metode <i>Jensen</i>	21
2.2 Penelitian Terdahulu	22
2.3 Kerangka Penelitian	26
2.4 Hipotesis	29

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN	30
3.1 Objek Penelitian	30
3.2 Metode Penelitian.....	31
3.2.1 Jenis Penelitian.....	32
3.2.2 Operasionalisasi Variabel.....	32
3.2.3 Teknik Pengumpulan Data	33
3.2.4 Model Penelitian	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Hasil Penelitian	39
4.1.1 Deskripsi Data Penelitian	39
4.1.2 Analisis Data	39
4.2 Pembahasan.....	54
4.2.1 Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode <i>Sharpe</i>	54
4.2.2 Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode <i>Treynor</i>	56
4.2.3 Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode <i>Jensen</i>	58
4.2.4 Perbandingan Analisis Kinerja Portofolio dengan Metode <i>Sharpe</i> , <i>Treynor</i> , dan <i>Jensen</i>	59
5.1 Kesimpulan	62
5.2 Saran	63
DAFTAR PUSTAKA	66
LAMPIRAN.....	70
RIWAYAT HIDUP.....	85

DAFTAR TABEL

Nomor	Judul	Halaman
2. 1	Kajian Penelitian Terdahulu ang Relevan	22
3. 1	Tabel Daftar Saham IDX30 Tahun 2023	31
3. 2	Definisi Operasionalisasi Variabel	33
3. 3	Daftar Saham Terpilih IDX30 2019-2023	35
4. 1	<i>Return</i> Saham.....	40
4. 2	Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode <i>Sharpe</i>	43
4. 3	Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode <i>Treynor</i>	45
4. 4	Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode <i>Jensen</i>	48
4. 5	Hasil Perhitungan Zscore	50
4. 6	Hasil Uji <i>Kruskal-wallis</i>	46
4. 7	Hasil <i>Mean Rank</i>	47

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Judul	Halaman
1. 1	Ilustrasi Perbandingan Pasar Indeks	8
3. 1	Model Penelitian	35

DAFTAR SIMBOL

No.	Singkatan	Istilah
1	A	<i>Alpha</i>
2	B	Beta
3	ρ	Rho
4	σ	Sigma

DAFTAR SINGKATAN

No.	Singkatan	Istilah
1	ERB	Excess <i>Return</i> To Beta
2	Ci	Cutt-off rate
3	CAPM	Capital Asset Pricing Model
4	IHSG	Indeks Harga Saham Gabungan
5	BEI	Bursa Efek Indonesia
6	EBITDA	Earning Before Interest, Taxes, Depreciation, and Amortization
7	RVAR	Reward to Variability Ratio
8	RVOL	Reward to Volatility Ratio

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Judul	Halaman
1.	Jadwal Penelitian.....	71