

Kasiani Dwi Puji Rahayu, 14311030, **Kinerja Portofolio Saham Menggunakan Metode *Sharpe*, Metode *Treynor*, Dan Metode *Jensen* Pada Sektor Semen Dan Sektor Mesin & Alat Berat Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia**, Manajemen, Fakultas Ekonomi Dan Bisnis, Universitas Muhammadiyah Gresik, Juli, 2018.

### **Abstrak**

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis Metode *Sharpe*, *Treynor*, serta *Jensen* yang mampu memberikan return secara optimal. Jumlah sampel dalam penelitian ini sejumlah 18 perusahaan. Teknik analisis penelitian ini menggunakan metode *Sharpe*, *Jensen* dan *Treynor*. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa kinerja portofolio saham yang mampu memberikan return tinggi ialah pada PT Semen Baturaja (persero) Tbk (SMBR) dengan nilai Indeks *Sharpe* sebesar 0,5454. Kinerja portofolio saham yang mampu memberikan return tinggi ialah pada PT Holcim Indonesia Tbk (SMCB) dengan nilai indeks *Treynor* sebesar 270,9172. Kinerja portofolio saham yang mampu memberikan return tinggi ialah pada PT Semen Baturaja (persero) Tbk (SMBR) dengan nilai Indeks *Jensen* sebesar 0.9942.

Kata kunci : Metode *Sharpe*, Metode *Treynor*, Metode *Jensen*

Kasiani Dwi Puji Rahayu, 14311030, *Stock Portfolio Performance Using Sharpe Method, Treynor Method, And Jensen Method In Cement Sector And Heavy Equipment & Heavy Equipment Sector Listed In Indonesia Stock Exchange, Management, The Faculty Economic And Business, The University Of Muhammadiyah Gresik, July, 2018.*

***Abstract***

*. This study aims to analyze the Sharpe, Treynor, and Jensen methods that are able to provide optimal returns. The number of samples in this study were 18 companies. The analysis technique of this research uses Sharpe, Jensen and Treynor methods. The results of this study indicate that the performance of the stock portfolio that is able to provide high returns is at PT Semen Baturaja (persero) Tbk (SMBR) with the Sharpe Index value of 0.5454. Stock portfolio performance that is able to provide high returns is at PT Holcim Indonesia Tbk (SMCB) with a Treynor index value of 270,9172. Stock portfolio performance that is able to provide high returns is at PT Semen Baturaja (persero) Tbk (SMBR) with a Jensen Index value of 0.9942.*

*Keywords: Sharpe Method, Treynor Method, Jensen Method*