

**KEMENTERIAN RISET, TEKNOLOGI DAN PERGURUAN TINGGI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

**PROGRAM STUDI : EKONOMI ISLAM
DAFTAR No. :**

ABSTRAK

SKRIPSI SARJANA EKONOMI ISLAM

**NAMA : BAYU DYNAPUTRA
NIM : 041311433195
TAHUN PENYUSUNAN : 2017**

JUDUL:

“Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal, Kinerja JII dan Kinerja LQ45, yang Terdaftar di BEI Dengan Metode Sharpe”

ISI:

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui perbedaan kinerja portofolio optimal, kinerja JII dan kinerja LQ45. Pengukuran kinerja menggunakan metode sharpe yang didapatkan dari membagi premi resiko (sama dengan selisih rata-rata tingkat keuntungan dengan rata-rata bunga bebas resiko) dengan standar deviasinya (resiko total).

Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif. Dalam membentuk portofolio optimal 15 sampel saham yang terus masuk kedalam JII selama periode 2012-2016 menggunakan model indeks tunggal. Setelah itu membandingkan Kinerja antara portofolio optimal, JII dan LQ45 pada periode Januari 2016-Nopember 2017 menggunakan teknik analisis *One-Way Anova*

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa terdapat 6 saham yang masuk ke dalam portofolio optimal dan tidak terdapat perbedaan kinerja antara portofolio optimal, JII, dan LQ45 menggunakan metode sharpe pada periode Januari 2016 hingga Nopember 2017.

Kata Kunci: Potofolio Optimal, Metode Sharpe, Model Indeks Tunggal, Perbandingan Kinerja

**MINISTRY OF RESEARCH, TECHNOLOGY, AND HIGHER
EDUCATION
FACULTY OF ECONOMICS AND BUSINESS UNIVERSITAS
AIRLANGGA**

**STUDY PROGRAM: ISLAMIC ECONOMIC
LIST NUMBER:**

ABSTRACT

ISLAMIC ECONOMICS BACHELOR DEGREE THESIS

**NAME : Bayu Dynaputra
NIM : 041311433195
COMPOSING YEAR : 2017**

TITLE:

The Comparison of Optimal Portfolio Performance, JII Performance, and LQ45 Performance Listed on IDX Using Sharpe Method

CONTENTS:

This study aims to determine the differences of financial performance of This study aims to determine the difference of optimal portfolio performance, JII performance and LQ45 performance. Performance measurement uses the sharpe method derived from dividing the risk premium (equal to the difference in average rate of return with an average risk free interest rate) with the standard deviation (total risk).

This research is a quantitative research, to form an optimal portfolio of 15 stock samples that continue to enter into JII during period 2012-2016 using single index model. After that compares the performance between optimal portfolio, JII and LQ45 in the period of January 2016-November 2017 using One-Way Anova analysis technique

The results of this study indicate there are 6 stocks that enter into the optimal portfolio and there is no difference in performance between optimal portfolio, JII, and LQ45 using sharpe method in the period January 2016 until November 2017.

Keywords: *Optimal Portofolio, Sharpe Method, Single Index Model, Performance Comparison.*