

**ANALISIS KINERJA PORTOFOLIO SAHAM LQ45 DENGAN METODE  
SHARPE, TREYNOR DAN JENSEN PADA PERIODE  
JANUARI 2019 - DESEMBER 2022**

**Isnanda Anas Sahrldo**

**NIM. 141180144**

[isnanda.anas@gmail.com](mailto:isnanda.anas@gmail.com)

Mahasiswa Program Studi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

**ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui kinerja portofolio saham pada perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ45 yang diukur dengan menggunakan metode *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen* selama periode Januari 2019 – Desember 2022. Populasi dalam penelitian ini adalah saham-saham yang masuk dalam indeks LQ45 pada periode Januari 2019 – Desember 2022. Data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh dari Bursa Efek Indonesia (BEI) dan Yahoo Finance. Metode yang digunakan dalam pengambilan sampel adalah *purposive sampling*. Data yang diperoleh dari metode sampling tersebut adalah 24 perusahaan. Data dalam penelitian diolah menggunakan *Microsoft Excel 2019*. Hasil penelitian menyimpulkan bahwa metode *Jensen* menunjukkan angka yang paling baik dalam mengukur kinerja portofolio. Dari ketiga metode tersebut, dianjurkan bagi investor dan calon investor untuk menggunakan metode *Jensen* dalam mengukur kinerja portofolio.

**Kata Kunci:** Portofolio, Saham, LQ45, *Sharpe*, *Treynor*, *Jensen*