

**ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA SAHAM SEKTOR ENERGI
INDONESIA DAN MALAYSIA MENGGUNAKAN INDEKS *SHARPE*,
JENSEN, DAN *TREYNOR***

DIVA FITRI NUR'AINI

NIM. 141200227

Email: divanurainii12@gmail.com

Dosen Pembimbing:

Dra. Sri Isworo Ediningsih, M.M

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis kinerja saham dengan menggunakan Indeks *Sharpe*, *Jensen*, dan *Treynor*. Jenis penelitian ini adalah penelitian komparatif dengan membandingkan kinerja saham Sektor Energi Indonesia dan Malaysia. Sampel penelitian ini sebanyak 11 perusahaan yang terdapat di Sektor Energi Indonesia dan 4 perusahaan yang terdapat di Sektor Energi Malaysia, teknik penentuan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Adapun teknik analisis data yang digunakan adalah uji normalitas dan uji perbandingan yaitu *Paired Sample T-Test* untuk data yang terdistribusi normal dan alternatif uji beda *Wilcoxon test* untuk data yang tidak terdistribusi normal. Hasil penelitian ini menunjukkan tidak terdapat perbedaan kinerja saham yang diukur menggunakan Indeks *Sharpe*, *Jensen*, dan *Treynor* pada perusahaan Sektor Energi Indonesia dan Malaysia

Kata Kunci: Perusahaan Sektor Energi Indonesia, Perusahaan Sektor Energi Malaysia, *Indeks Sharpe*, *Indeks Treynor* dan *Indeks Jensen*