

**ANALISIS KINERJA PORTOFOLIO SAHAM DENGAN METODE SORTINO,
TREYNOR DAN RASIO INFORMASI
(SAHAM IDX30 TAHUN 2018-2021)**

Oleh:

Asti Yudantisiwi

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui kinerja portofolio pada saham yang terdaftar di IDX30 dalam periode 2018-2021 dengan menggunakan metode Sortino, Treynor, dan Rasio Informasi. Penelitian ini merupakan Jenis penelitian kuantitatif deskriptif dengan metode *level of explanation*. Populasi dalam penelitian ini ialah perusahaan yang terdaftar pada IDX30 periode 2018-2021 dengan sampel penelitian sebanyak 17 perusahaan. Hasil penelitian untuk perhitungan dengan metode sortino menunjukkan kinerja portofolio pada saham IDX30 periode 2018-2021 memiliki nilai yang negatif. Untuk perhitungan dengan metode treynor menunjukkan kinerja portofolio pada saham IDX30 periode 2018-2021 memiliki nilai yang positif. Untuk perhitungan dengan metode rasio informasi menunjukkan kinerja portofolio pada saham IDX30 periode 2018-2021 di peroleh nilai yang positif, metode ini menunjukkan konsistensi sehingga mampu memberikan pandangan yang baik pada investor. 3 metode yang digunakan untuk mengetahui kinerja portofolio pada saham yang terdaftar di IDX30 dalam periode 2018-2021 pada setiap metodenya memiliki nilai yang berbeda.

Kata kunci : IDX30, Portofolio, Sortino, Treynor, Rasio Informasi.

ABSTRACT

THE ANALYSIS OF STOCK PORTFOLIO PERFORMANCE WITH SORTINO, TREYNOR AND INFORMATION RATIO METHOD (IDX30 STOCK FOR 2018-2021)

By:

Asti Yudantisiwi

astiyudantisiwi12@gmail.com

The purpose of this study is to determine the performance of a portfolio of stocks listed on the IDX30 from 2018 to 2021 using the Sortino, Treynor and Information Ratio methods. This study is a kind of descriptive quantitative research using the explanatory level method. The study population is companies listed on the IDX30 for the period 2018-2021, with a study sample of 17 companies. Findings using the Sortino method show the negative performance of the portfolio of IDX30 stocks for the period 2018-2021. The Treynor method calculations yield positive portfolio performance for the IDX30 stock from 2018 to 2021. Calculated using the information ratio method, the portfolio performance of IDX30 stocks for the period 2018-2021 is positive, and the method is consistent and provides an overview of investors. The three methods used to determine the performance of a portfolio of stocks listed on the IDX30 over the period 2018-2021 have different values for each method..

Keywords: IDX30, Portfolio, Sortino, Treynor, Information Ratio.

