

**ANALISIS KINERJA PORTOFOLIO SAHAM BERKELANJUTAN  
INDEKS SRI KEHATI DAN NONBERKELANJUTAN INDEKS LQ45  
DENGAN RASIO *SHARPE*, *TREYNOR*, DAN *JENSEN ALPHA***

Skripsi

Untuk Memenuhi Persyaratan Guna Mencapai Derajat Sarjana S1 Program Studi

Manajemen



Dosen Pembimbing:

Prof. Dr. Tandelilin Eduardus, M.B.A.

Oleh:

Nyimas Cahyani Qolbi

20/461244/EK/23200

**Program Studi Manajemen  
Fakultas Ekonomika dan Bisnis  
Universitas Gadjah Mada  
Yogyakarta  
2024**



**Analisis Kinerja Portofolio Saham Berkelanjutan Indeks SRI Kehati dan Nonberkelanjutan Indeks LQ45**

**dengan Rasio Sharpe, Treynor, dan Jensen Alpha**

NYIMAS CAHYANI QOLBI, Prodi. Dr. Tandelilin Eduardus, M.B.A.

Universitas Gadjah Mada, 2024 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS

Dengan ini saya menyatakan bahwa tugas akhir dengan judul:

**Analisis Kinerja Portofolio Saham Berkelanjutan Indeks Sri Kehati dan Nonberkelanjutan Indeks LQ45 dengan Rasio *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen Alpha***

Disusun oleh  
Nyimas Cahyani Qolbi  
20/461244/EK/23200

Telah saya baca dengan seksama dan telah dinyatakan memenuhi standar ilmiah, baik jangkauan maupun kualitasnya, sebagai skripsi jenjang Pendidikan Sarjana (S1).

Telah diujikan pada 17 September 2024

Tim Penguji	Nama Lengkap	Tanda Tangan
Pembimbing	Prof. Dr. Tandelilin Eduardus, M.B.A.	
Penguji 1	Drs. Agastya, MBA, MPM.	
Penguji 2	I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.	

Mengetahui,  
Wakil Dekan Bidang Akademik dan Kemahasiswaan

Bayu Sutikno, S.E., M.S.M., Ph.D.  
NIP 197805202005011002