

**PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO OPTIMAL
SAHAM SYARIAH JAKARTA ISLAMIC INDEX
BERDASARKAN RASIO SHARPE, TREYNOR, DAN JENSEN
PERIODE 2020-2024**

SKRIPSI



Oleh:
Silvi Laisa Nurika
NIM. 126406211062

**PROGRAM STUDI
MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI RAHMATULLAH
TULUNGAGUNG
MEI 2025**

**PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO OPTIMAL
SAHAM SYARIAH JAKARTA ISLAMIC INDEX
BERDASARKAN RASIO SHARPE, TREYNOR, DAN JENSEN
PERIODE 2020-2024**

SKRIPSI

Disusun dalam rangka memenuhi salah satu persyaratan
Menempuh program Sarjana (S1)
Manajemen Keuangan Syariah
Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Islam UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung

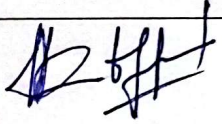


Oleh:
Silvi Laisa Nurika
NIM. 126406211062

**PROGRAM STUDI
MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI RAHMATULLAH
TULUNGAGUNG
MEI 2025**

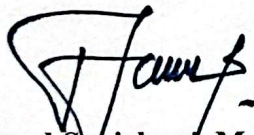
PERSETUJUAN PEMBIMBING

Skripsi dengan judul “Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Saham Syariah JII Berdasarkan Rasio Sharpe, Treynor, dan Jensen Periode 2020-2024” yang ditulis oleh Silvi Laisa Nurika, NIM. 126406211062 ini telah diperiksa dan disetujui, serta layak diujikan.

Promotor/Pembimbing	Tanggal	Tanda Tangan
<u>Dr. Rokhmat Subagiyo, S.E., M.E.I</u> NIP. 197907212014031001	19 Maret 2025	

Mengetahui,

Koordinator Program Studi Manajemen Keuangan Syariah


Ahmad Syaichoni, M.Sy.
NIP. 199101222018011002

PENGESAHAN

Skripsi dengan judul “Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Saham Syariah JII Berdasarkan Rasio Sharpe, Treynor, dan Jensen Periode 2020-2024” yang ditulis oleh Silvi Laisa Nurika, NIM. 126406211062” ini telah dipertahankan di depan dewan penguji pada: Tanggal: 02 Bulan: Mei Tahun: 2025 dan telah dinyatakan diterima sebagai salah satu persyaratan untuk memperoleh gelar sarjana dalam keilmuan Manajemen Keuangan Syariah.

Dewan Penguji

Tanda Tangan

Ketua / Penguji :

Dr. Rokhmat Subagiyo, S.E., M.E.I.
NIP. 197907212014031001



Penguji Utama :

Dr. Muhamad Aswad, S.Ag., M.A.
NIP. 197506142008011009



Sekretaris / Penguji :

Labib Muzaki Sobir, S.Hum., M.Pd.I.
NIDN. 2016048005



Mengesahkan,
Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam
Universitas Islam Negeri Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung



Dr. Chusnul Chotimah, M.Ag.
NIP. 197512112002122001

SURAT PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI

Yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : Silvi Laisa Nurika

Nim : 126406211062

Program Studi : Manajemen Keuangan Syariah

Jurusan : Bisnis dan Manajemen

Semester : VIII (Delapan)

Menyatakan bahwa skripsi dengan judul “Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Saham Syariah JII Berdasarkan Rasio Sharpe, Treynor, dan Jensen Periode 2020-2024” ini secara keseluruhan adalah hasil penelitian karya saya sendiri, kecuali pada bagian-bagian yang dirujuk sumbernya, dan bebas dari plagiarisme. Jika dikemudian hari terbukti bukan karya sendiri atau melakukan plagiarisme, maka saya siap ditindak sesuai dengan ketentuan yang berlaku.

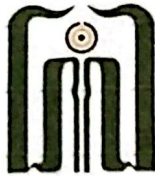
Tulungagung, 19 Maret 2025

Saya yang menyatakan,



Silvi Laisa Nurika

NIM. 126406211062



**KEMENTERIAN AGAMA REPUBLIK INDONESIA
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SAYYID ALI RAHMATULLAH TULUNGAGUNG
UPT PERPUSTAKAAN**

Jalan Mayor Sujadi Timur Nomor 46 Tulungagung - Jawa Timur 66221
Telepon (0355) 321513, Website : <http://perpustakaan.uinsatu.ac.id>

SURAT PERNYATAAN KESEDIAAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama : SILVI LAISA NURIKA
NIM : 126406211062
Jurusan : MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
Fakultas : EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
Jenis Karya Ilmiah : SKRIPSI

Demi pengembangan ilmu pengetahuan, menyetujui untuk memberikan Hak Bebas Royalti Non-eksklusif (Non-exclusive Royalty-Free Right) kepada UPT Perpustakaan UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung atas karya ilmiah saya berupa (SKRIPSI) yang berjudul:

PERBANDINGAN KINERJA PORTOFOLIO OPTIMAL SAHAM SYARIAH
JAKARTA ISLAMIC INDEX BERDASARKAN RASIO SHARPE,
TREYNOR, DAN JENSEN PERIODE 2020 - 2024

Dengan Hak Bebas Royalti Non-eksklusif ini UPT Perpustakaan UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung berhak menyimpan, alih media/format, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*), merawat, dan mempublikasikan tugas akhir saya selama tetap mencantumkan nama saya sebagai penulis/pencipta dan sebagai pemilik Hak Cipta.

Demikian pernyataan ini saya buat untuk dapat dipergunakan sebagaimana mestinya.

Tulungagung, 23 MEI 2025
Yang Menyatakan,



SILVI LAISA NURIKA
Nama terang dan tanda tangan