

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh *Risk premium*, BOPO dan *Indeks treynor* terhadap kinerja Portofolio saham pada perusahaan perbankan di Indonesia yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini menggunakan metode deskriptif kuantitatif populasi dalam penelitian ini adalah semua perusahaan perbankan yang berada di Indonesia dengan jumlah 37 bank. teknik yang digunakan adalah purposive sampling yaitu teknik penentuan sampel dengan pertimbangan tertentu. Bank umum yang memenuhi kriteria untuk menjadi sampel adalah 10 Bank. Metode analisis yang digunakan adalah regresi linier berganda menggunakan *eviews 09*.

Hasil penelitian yang didapatkan berdasarkan Uji Parsial (Uji t) diperoleh *Risk premium* dan BOPO secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap kinerja Portofolio dan *Indeks treynor* secara parsial berpengaruh signifikan terhadap kinerja Portofolio. Sedangkan uji secara Simultan (Uji F) diperoleh bahwa *Risk premium* BOPO dan *Indeks treynor* berpengaruh signifikan terhadap kinerja Portofolio pada perusahaan perbankan di Indonesia. Kontribusi *Risk premium* (X1), Biaya Operasional Pendapatan Operasional (X2) dan Indeks treynor (X3) terhadap kinerja Portofolio (Y).

Hasil ini sejalandengan hasil penelitian (Anak Agung Ngurah Mustakawarman 2016) dan (Syamni 2018). (Musdalifah azziz 2017) dan (Sri Aeni Syulviya 2015) dan (Huzaimah n.d.) dan (Nurman Eduwinsah 2018)

Kata kunci : Risk premium, BOPO, Indeks Treynor dan Portofolio

ABSTRACT

This study aims to determine and analyze the effect of Risk premium, BOPO and Treynor Index on the performance of stock portfolios in banking companies in Indonesia which are listed on the Indonesia Stock Exchange.

This study used a quantitative descriptive method. The population in this study were all banking companies in Indonesia with a total of 37 banks. The technique used is purposive sampling, namely the sampling technique with certain considerations. There are 10 commercial banks that meet the criteria to be sampled. The analytical method used is multiple linear regression using eviews 09.

The results obtained based on the partial test (t test) obtained that Risk premium and BOPO partially have no significant effect on portfolio performance and treynor index partially has a significant effect on portfolio performance. While the simultaneous test (UjiF) shows that the Risk premium BOPO and treynor index have a significant effect on portfolio performance in banking companies in Indonesia. Contribution of Risk premium (X1), Operating Costs to Operating Income (X2) and Treynor Index (X3) on Portfolio performance (Y).

This result is in line with the results of the study (Anak Agung Ngurah Mustakawarman 2016) and (Syamni 2018). (Musdalifah azziz 2017) and (Sri Aeni Syulviya 2015) and (Huzaimah nd) and (Nurman Eduwinsah 2018)

Keywords: Risk premium, BOPO, Treynor Index and Portfolio