

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu .....	19
Tabel 3.1	Karakteristik Penelitian.....	25
Tabel 3.2	Variabel Operasional.....	27
Tabel 3.3	Kriteria Pemilihan Sampel .....	30
Tabel 3.4	Daftar Saham Perusahaan yang Digunakan Sebagai Sampel .....	31
Tabel 4.1	Return Harapan Saham dan IHSG .....	40
Tabel 4.2.	Hasil Perhitungan Varian dan Standar Deviasi.....	41
Tabel 4.3	Hasil Perhitungan Beta Saham.....	43
Tabel 4.4	Hasil Perhitungan Alpha Saham .....	44
Tabel 4.5	Hasil Risiko Tidak Sistematis Saham .....	45
Tabel 4.6	Data Suku Bunga Periode 2013-2018 .....	46
Tabel 4.7	Risk Free Rate Strategi Pasif Periode 2013-2018.....	47
Tabel 4.8	Risk Free Rate Strategi Aktif Tahunan Periode 2013-2018 .....	47
Tabel 4.9	Risk Free Rate Strategi Aktif Semesteran Periode 2013-2018 ....	47
Tabel 4.10	Jumlah Pembentukan Portofolio Periode 2013-2018 .....	49
Tabel 4.11	Pengelompokan PBV Tahun 2013 .....	50
Tabel 4.12	Pembobotan Portofolio Rasio PBV Periode 2013 .....	51
Tabel 4.13	Perhitungan Beta Portofolio Rasio PBV Periode 2013.....	52
Tabel 4.14	Perhitungan Alpha Portofolio Rasio PBV Periode 2013 .....	53
Tabel 4.15	Perhitungan Risiko Tidak Sistematis Portofolio Rasio PBV Periode 2013 .....	54
Tabel 4.16	Return Portofolio Strategi Pasif Periode 2013-2018.....	55
Tabel 4.17	Return Portofolio Strategi Aktif Tahunan Periode 2013-2018...	56
Tabel 4.18	Return Portofolio Strategi Aktif Semesteran Periode 2013-2018	56
Tabel 4.19	Risiko Portofolio Strategi Pasif Periode 2013-2018.....	58
Tabel 4.20	Risiko Portofolio Strategi Aktif Tahunan Periode 2013-2018....	58
Tabel 4.21	Risiko Portofolio Strategi Aktif Semesteran Periode 2013-2018	59
Tabel 4.22	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Sharpe Pada Strategi Pasif	61

Tabel 4.23	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Sharpe Pada Strategi Aktif Tahunan .....	61
Tabel 4.24	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Sharpe Pada Strategi Aktif Semesteran .....	62
Tabel 4.25	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Treynor Pada Strategi Pasif	63
Tabel 4.26	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Treynor Strategi Aktif Tahunan .....	64
Tabel 4.27	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Treynor Pada Strategi Aktif Semesteran .....	64
Tabel 4.28	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Jensen Pada Strategi Pasif...	66
Tabel 4.29	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Jensen Pada Strategi Aktif Tahunan.....	66
Tabel 4.30	Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Jensen Pada Strategi Aktif Semesteran .....	68
Tabel 4.31	Ranking Return Pada Strategi Portofolio Pasif.....	68
Tabel 4.32	Ranking Return Pada Strategi Portofolio Aktif Tahunan .....	69
Tabel 4.33	Ranking Return Pada Strategi Portofolio Aktif Semesteran.....	70
Tabel 4.34	Ranking Risiko Pada Strategi Portofolio Pasif .....	70
Tabel 4.35	Ranking Risiko Pada Strategi Portofolio Aktif Tahunan.....	71
Tabel 4.36	Ranking Risiko Pada Strategi Portofolio Aktif Semesteran .....	72
Tabel 4.37	Ranking Sharpe Pada Strategi Portofolio Pasif.....	72
Tabel 4.38	Ranking Sharpe Pada Strategi Portofolio Aktif Tahunan .....	73
Tabel 4.39	Ranking Sharpe Pada Strategi Portofolio Aktif Semesteran.....	73
Tabel 4.40	Ranking Treynor Pada Strategi Portofolio Pasif.....	74
Tabel 4.41	Ranking Treynor Pada Strategi Portofolio Aktif Tahunan .....	74
Tabel 4.42	Ranking Treynor Pada Strategi Portofolio Aktif Semesteran.....	74
Tabel 4.43	Ranking Jensen Pada Strategi Portofolio Pasif.....	75
Tabel 4.44	Ranking Jensen Pada Strategi Portofolio Aktif Tahunan.....	75
Tabel 4.45	Ranking Jensen Pada Strategi Portofolio Aktif Semesteran.....	76