

DAFTAR TABEL

Tabel 1. 1	Perbandingan <i>Return</i> Harian Indeks Saham Indonesia	3
Tabel 2. 1	Penelitian Terdahulu	25
Tabel 3. 1	Karakteristik Penelitian.....	32
Tabel 3. 2	Operasional Variabel	37
Tabel 3. 3	Karakteristik Sampel.....	41
Tabel 3. 4	Daftar Sampel Saham Perusahaan Terpilih.....	41
Tabel 4. 1	<i>Expected Return</i> Saham dan IHSG Portofolio Pasif	52
Tabel 4. 2	Varians dan Standar Deviasi Saham dan IHSG Portofolio Pasif	54
Tabel 4. 3	<i>Beta</i> dan <i>Alpha</i> Saham dan IHSG Portofolio Pasif	56
Tabel 4. 4	Risiko <i>Unsystematic</i> Saham Portofolio Pasif.....	57
Tabel 4. 5	Nilai <i>Risk Free Rate</i> Periode 2015-2019	58
Tabel 4. 6	Nilai <i>Risk Free Rate</i> Portofolio Pasif 2015-2019.....	59
Tabel 4. 7	Nilai <i>Risk Free Rate</i> Portofolio Aktif Per-Tahun.....	59
Tabel 4. 8	Nilai <i>Risk Free Rate</i> Portofolio Aktif Per-Semester	59
Tabel 4. 9	Pembobotan Portofolio Pasif 2015-2019 Berdasarkan Rasio ROE ...	61
Tabel 4. 10	<i>Beta</i> Portofolio Pasif 2015-2019 Berdasarkan Rasio ROE.....	64
Tabel 4. 11	<i>Alpha</i> Portofolio Pasif 2015-2019 Berdasarkan Rasio ROE	65
Tabel 4. 12	Risiko <i>Unsystematic</i> Portofolio Pasif Berdasarkan Rasio ROE.....	66
Tabel 4. 13	<i>Expected Return</i> Portofolio Pasif 2015-2019 dan IHSG	67
Tabel 4. 14	<i>Expected Return</i> Portofolio Aktif Per-Tahun 2015 dan IHSG.....	68
Tabel 4. 15	<i>Expected Return</i> Portofolio Aktif Per-Tahun dan IHSG	68
Tabel 4. 16	<i>Expected Return</i> Portofolio Aktif Per-Semester dan IHSG.....	69
Tabel 4. 17	Risiko Portofolio Pasif 2015-2019 dan IHSG.....	70
Tabel 4. 18	Risiko Portofolio Aktif Per-Tahun 2015 dan IHSG	71
Tabel 4. 19	Risiko Portofolio Aktif Per-Tahun dan IHSG.....	71
Tabel 4. 20	Risiko Portofolio Aktif Per-Semester dan IHSG	72
Tabel 4. 21	Rasio <i>Sharpe</i> Portofolio Pasif 2015-2019 dan IHSG	73
Tabel 4. 22	Rasio <i>Sharpe</i> Portofolio Aktif Per-Tahun dan IHSG	73
Tabel 4. 23	Rasio <i>Sharpe</i> Portofolio Aktif Per-Semester dan IHSG	74

Tabel 4. 24 Rasio <i>Treynor</i> Portofolio Pasif 2015-2019 dan IHSG.....	75
Tabel 4. 25 Rasio <i>Treynor</i> Portofolio Aktif Per-Tahun dan IHSG.....	76
Tabel 4. 26 Rasio <i>Treynor</i> Portofolio Aktif Per-Semester dan IHSG	76
Tabel 4. 27 Rasio <i>Jensen</i> Portofolio Pasif 2015-2019 dan IHSG.....	78
Tabel 4. 28 Rasio <i>Jensen</i> Portofolio Aktif Per-Tahun dan IHSG.....	78
Tabel 4. 29 Rasio <i>Jensen</i> Portofolio Aktif Per-Semester dan IHSG	79
Tabel 4. 30 <i>Ranking Expected Return</i> Portofolio Pasif 2015-2019	80
Tabel 4. 31 <i>Ranking</i> Risiko Portofolio Pasif 2015-2019	81
Tabel 4. 32 <i>Ranking Expected Return</i> Portofolio Aktif Per-Tahun	82
Tabel 4. 33 <i>Ranking</i> Risiko Portofolio Aktif Per-Tahun	83
Tabel 4. 34 <i>Ranking Expected Return</i> Portofolio Aktif Per-Semester.....	85
Tabel 4. 35 <i>Ranking</i> Risiko Portofolio Aktif Per-Semester	85
Tabel 4. 36 Perbandingan <i>Expected Return</i> dan Risiko Manajemen Portofolio ...	87
Tabel 4. 37 <i>Ranking</i> Rasio <i>Sharpe</i> Portofolio Pasif 2015-2019.....	87
Tabel 4. 38 <i>Ranking</i> Rasio <i>Treynor</i> Portofolio Pasif 2015-2019	88
Tabel 4. 39 <i>Ranking</i> Rasio <i>Jensen</i> Portofolio Pasif 2015-2019	89
Tabel 4. 40 <i>Ranking</i> Rasio <i>Sharpe</i> Portofolio Aktif Per-Tahun.....	90
Tabel 4. 41 <i>Ranking</i> Rasio <i>Treynor</i> Portofolio Aktif Per-Tahun	91
Tabel 4. 42 <i>Ranking</i> Rasio <i>Jensen</i> Portofolio Aktif Per-Tahun	91
Tabel 4. 43 <i>Ranking</i> Rasio <i>Sharpe</i> Portofolio Aktif Per-Semester.....	92
Tabel 4. 44 <i>Ranking</i> Rasio <i>Treynor</i> Portofolio Aktif Per-Semester.....	93
Tabel 4. 45 <i>Ranking</i> Rasio <i>Jensen</i> Portofolio Aktif Per-Semester.....	94
Tabel 4. 46 Perbandingan Evaluasi Kinerja Manajemen Portofolio.....	94
Tabel 4. 47 Portofolio Optimal.....	96