

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Daftar Sampel Penelitian	2
Tabel 1.2	Pergerakan IHSG BEI November – Desember	6
Tabel 3.1	Jumlah Sampel Berdasarkan Kriteria Seleksi Sampel	40
Tabel 3.2	Daftar Sampel Penelitian	40
Tabel 4.1	Data Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Periode Februari 2010 – Januari 2015	52
Tabel 4.2	Suku Bunga Bank Indonesia Periode Februari 2010 – Januari 2015	53
Tabel 4.3	<i>Expected Return</i> E(R _i) dan Varian (σ_i^2) Saham Individu	54
Tabel 4.4	<i>Expected Return</i> E(R _m) dan Varian (σ_m^2) IHSG	55
Tabel 4.5	<i>Alpha</i> , <i>Beta</i> , dan Risiko Tidak Sistematis	57
Tabel 4.6	Hasil Perhitungan Nilai ERB (<i>Excess Return to Beta</i>)	59
Tabel 4.7	Hasil Perhitungan Nilai Pembatas (<i>Cut-off Point</i>) dan Penentuan Saham Kandidat Portofolio (ERB \geq C*)	60
Tabel 4.8	Proporsi Dana Saham Pembentuk Portofolio Optimal	62
Tabel 4.9	<i>Alpha</i> dan <i>Beta</i> Poertofolio	63
Tabel 4.10	<i>Return</i> dan Risiko Porotofolio	64