

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar Saham JII	2
Tabel 1.2 Daftar Saham yang Keluar dari JII	4
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	24
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian.....	32
Tabel 3.2 Variabel Operasional.....	33
Tabel 3.3 Daftar Sampel	37
Tabel 4.1 Periode Pengamatan.....	45
Tabel 4.2 <i>Expected Return</i> dan Standar Deviasi Saham Kandidat Portofolio 2	47
Tabel 4.3 SBI Periode Januari 2012-Desember 2012	48
Tabel 4.4 Pemeringkatan Saham Berdasarkan ERS	50
Tabel 4.5 Korelasi Konstam Saham Kandidat Portofolio.....	51
Tabel 4.6 Perhitungan Ci dan <i>Cut-off Rate</i> Saham Kandidat Portofolio Periode 2, Januari 2012-Desember 2012.....	52
Tabel 4.7 Perbandingan ERS dengan <i>Cut-off Rate</i> Periode 2, Januari 2012-Desember 2012.....	54
Tabel 4.8 Daftar Pembentuk Portofolio	54
Tabel 4.9 Pembobotan Saham Portofolio.....	56
Tabel 4.10 Perbandingan JII, IHSG, dan LQ45	60
Tabel 4.11 Perbandingan JII, IHSG, dan LQ45	61