

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Kajian Perbedaan dan Persamaan Penelitian Terdahulu	34
Tabel 3.1 Kriteria Penelitian.....	46
Tabel 3.2 Operasionlisasi Variabel.....	47
Tabel 3.3 Kriteria dan Jumlah Sampel Penelitian	50
Tabel 3.4 Data Sampel Penelitian	50
Tabel 4.1 Perhitungan tingkat <i>return</i> pasar, <i>expected return</i> pasar, varians pasar, dan standar deviasi pasar.	57
Tabel 4. 2 Perhitungan Tingkat <i>Return</i> Saham, <i>Expected return</i> Saham, Varians Saham, dan Standar Deviasi	59
Tabel 4. 3 Rangkuman Perhitungan Tingkat <i>Return</i> Saham, <i>Expected</i> <i>Return</i> Saham, Varians Saham, dan Standard Deviasi	60
Tabel 4. 4 Perhitungan Kovarians Saham Dengan Pasar, Beta, Alfa, dan Varians <i>Error</i> Residual.	64
Tabel 4. 5 Tingkat <i>Return</i> Bebas Risiko	66
Tabel 4. 6 Perhitungan ERB_i	67
Tabel 4. 7 Perhitungan A_i , B_i , C_i Masing-Masing Saham dan Penentuan C^* (<i>Cut-off point</i>)	70
Tabel 4.8 Saham Pembentuk Portofolio Optimal	73
Tabel 4. 9 Proporsi Portofolio Optimal	74
Tabel 4. 10 Alpha & Beta Portofolio, <i>Expected Return</i> Portofolio, dan Risiko Portofolio	76
Tabel 4. 11 Perhitungan <i>Expected return</i> menggunakan CAPM	81
Tabel 4. 12 Pembentukan Portofolio Optimal dengan CAPM.....	85
Tabel 4. 13 <i>Return</i> dan Risiko Portofolio.....	89
Tabel 4. 14 Kinerja Portofolio Model Indeks Tunggal	92
Tabel 4. 15 Kinerja Portofolio CAPM	93
Tabel 5. 1 Perbandingan Kinerja Pembentukan Portofolio.....	98