

## DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 / 1-1 : Data Deskriptif Saham yang aktif diperdagangkan di Bursa Efek Jakarta (BEJ) Periode penelitian .....	140
Lampiran 2 / 1-37 : Contoh Perhitungan Return , Covarian- I,m, dan Varian Rm, Varian-ei pada Emiten (UNSP), serta Simpulan Data Hasil Perhitungan 27 Emiten Sample (37 halaman) .....	141
Lampiran 3 / 1-10 : Data Perhitungan Return Market (Rm) di BEJ Periode Januari 2002 Sampai Dengan Oktober 2003 (10 halaman) .....	178
Lampiran 4 / 1-4 : Data Perhitungan Risk Free (Rf) dari Bank Sentral Periode Januari 2002 sampai dengan Oktober 2003 (3 halaman) .....	188
Lampiran 5 / 1-1 : Hasil Perhitungan Excess Return to Beta (ERB) dari 27 Emiten .....	191
Lampiran 6 / 1-1 : Hasil Perhitungan Cut Off Rate .....	192
Lampiran 7 / 1-1 : Hasil Perhitungan Proporsi Dana Investasi pada masing-masing Emiten Terpilih .....	193
Lampiran 8 /1-1 : Data Hasil Perhitungan Return dan Resiko Portofolio Optimal yang terdiri dari 25 Saham Terpilih periode Januari 2002 sampai dengan Oktober 2003 .....	194
Lampiran 9 / 1-1 : Perhitungan Nilai Pasangan Urutan Ranking Nilai Trading Saham ERB Saham Terpilih .....	195