

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 R_m , Varian- e_i pada Emiten (UNSP), serta Simpulan Data Hasil Perhitungan 27 Emiten Sample (37 halaman)	141
Lampiran 3 / 1-10 : Data Perhitungan Return Market (R_m) di BEJ Periode Januari 2002 Sampai Dengan Oktober 2003 (10 halaman)	178
Lampiran 4 / 1-4 : Data Perhitungan Risk Free (R_f) 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