

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1. Data Return ILQ 45 Tahun 2007-2011.....	7
Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Terdahulu.....	36
Tabel 3.1 Populasi Penelitian.....	46
Tabel 3.2 Sample Penelitian.....	50
Tabel 3.3 Ringkasan Definisi Oprasional.....	66
Tabel 4.1 Saham LQ45 yang masuk objek penelitian.....	75
Tabel 5.1 Data IHSG Februari 2008-Januari 2012.....	104
Tabel 5.2 Data SBI-1 Februari 2008-Januari 2012.....	106
Tabel 5.3 E(Ri),STDev,dan Variance Saham Individual.....	108
Tabel 5.4 Alpha, Beta, dan Variance Error Saham.....	109
Tabel 5.5 Saham-saham yang $\beta > 1$	111
Tabel 5.5 Saham-saham yang $\beta < 1$	111
Tabel 5.7 Perhitungan ERB terhadap 17 saham.....	112
Tabel 5.8 Perhitungan Cut-off-point pada saham LQ45.....	114
Tabel 5.9 Saham Kandidat portofolio dan Non Kandidat.....	115
Tabel 5.10 Perhitungan Skala dan Proporsi Dana.....	117
Tabel 5.11 Koefisien Saham.....	118
Tabel 5.12 Kovarian Saham.....	119
Tabel 5.13 Return Portofolio.....	120

Tabel 5.14 Risiko Portofolio.....	121
Tabel 5.15 Hasil Uji One-Sample Kolmogrov Test.....	123
Tabel 5.16 Hasil Uji Non-parametic Mann-Whitney Test.....	124