

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Kinerja Bursa Efek Indonesia 2010-2014.....	3
Tabel 2.1 Perbandingan Penelitian Terdahulu .....	40
Tabel 3.1 Variabel Operasional Penelitian.....	45
Tabel 3.2 Sampel Penelitian.....	48
Tabel 4.1 <i>Return</i> Ekspektasian (E(R)) (%) .....	53
Tabel 4.2 Risiko (Deviasi Standar ( $\sigma$ ) dan Varian( $\sigma^2$ )) (%) .....	53
Tabel 4.3 <i>Return</i> dan Risiko Pasar (%).....	54
Tabel 4.4 Beta ( $\beta$ ).....	55
Tabel 4.5 Alpha ( $\alpha$ ) .....	57
Tabel 4.6 Risiko Tidak Sistematis ( $\sigma_{ei}^2$ ).....	57
Tabel 4.7 Urutan Saham Berdasarkan ERB.....	58
Tabel 4.8 Perhitungan <i>Cut Off Point</i> untuk <i>Single Index Model</i> .....	60
Tabel 4.9 Proporsi Investasi Optimum untuk <i>Single Index Model</i> .....	61
Tabel 4.10 <i>Return</i> , Risiko dan Beta Portfolio <i>Single Index Model</i> .....	61
Tabel 4.11 Urutan Saham Berdasarkan ERS .....	62
Tabel 4.12 Perhitungan <i>Cut Off Point</i> untuk <i>Constant Correlation Model</i> .....	64
Tabel 4.13 Proporsi Investasi (W) Optimum <i>Constant Correlation Model</i> .....	65
Tabel 4.14 <i>Return</i> , Risiko dan Beta Portfolio <i>Constant Correlation Model</i> .....	66
Tabel 4.15 Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal .....	67