

DAFTAR TABEL

Tabel 1. 1 Saham LQ45 selama periode Februari 2020-Juli 2021.....	12
Tabel 2. 1 Kajian Penelitian Terdahulu	41
Tabel 3. 1 Karakteristik Penelitian.....	48
Tabel 3. 2 Operasional Variabel.....	48
Tabel 3. 3 Proses Pemilihan Sampel Penelitian	51
Tabel 3. 4 Sampel Penelitian.....	51
Tabel 4. 1 Daftar Saham LQ45 periode Februari 2020-Juli 2021 yang menjadi sampel penelitian.....	63
Tabel 4. 2 Hasil Perhitungan <i>Expected Return</i> , <i>Variance</i> dan Standar Deviasi Individual Saham	65
Tabel 4. 3 Data Saham Calon Kandidat Portofolio Optimal.....	68
Tabel 4. 4 <i>Expected Return</i> Pasar, <i>Variance</i> Pasar dan Standar Deviasi Pasar Periode Februari 2020-Juli 2021	69
Tabel 4. 5 Hasil Perhitungan Risk Free Rate Periode Februari 2020-Juli 2021	70
Tabel 4. 6 Hasil Perhitungan Alpha, Beta, <i>Variance</i> Error dan <i>Excess Return</i> to Beta (ERB).....	72
Tabel 4. 7 Hasil Perhitungan Ai, Bi dan Ci	76
Tabel 4. 8 Perbandingan Nilai ERB dan Ci Untuk Penentuan Cut Off Point (C*)	76
Tabel 4. 9 Penentuan Kandidat Portofolio Optimal	77
Tabel 4. 10 Proporsi Dana Portofolio Optimal	79
Tabel 4. 11 Hasil Perhitungan Alpha Portofolio, Beta Portofolio dan <i>Variance</i> Error Portofolio	80
Tabel 4. 12 <i>Expected Return</i> Portofolio dan Risiko Portofolio	81