

## DAFTAR TABEL

Tabel	
Halaman	
Tabel 1.1 Data <i>Return</i> dan Risiko Saham Anggota Indeks LQ-45 periode 2010-2012 .....	3
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	35
Tabel 3.1 Saham Pembentuk Indeks LQ-45 yang Selalu Tercatat Selama Periode 2010-2012.....	42
Tabel 3.2 Ringkasan Definisi Operasional dan Variabel Penelitian .....	46
Tabel 4.1 Sampel Penelitian.....	53
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif <i>Return</i> saham-saham Emiten yang Termasuk dalam Indeks LQ-45 Selama Periode 2010-2012.....	73
Tabel 4.3 Total Indeks Riil Penjualan Eceran.....	74
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Indeks Riil Penjualan Eceran.....	75
Tabel 4.5 Hasil Pengujian Regresi Tahap Pertama.....	76
Tabel 4.6 <i>Mean Return</i> Saham-Saham yang Termasuk dalam Indeks LQ-45 dan Beta Konsumsi .....	81
Tabel 4.7 Hasil Pengujian Regresi Tahap Kedua.....	82
Tabel 4.8 <i>Return</i> Ekspektasian dan Risiko Saham Individual .....	85
Tabel 4.9 <i>Return</i> dan Risiko Pasar .....	87
Tabel 4.10 Beta Konsumsi dan Alpha Sekuritas.....	88
Tabel 4.11 Perhitungan Kesalahan Residu dan Varian Kesalahan Residu .....	91
Tabel 4.12 Perhitungan <i>Excess Return to Beta</i> (ERB) .....	92
Tabel 4.13 Titik Pembatas ( <i>Cut Off Point</i> ) .....	93
Tabel 4.14 Proporsi Saham dalam Portofolio Optimal .....	95
Tabel 4.15 Perhitungan <i>Return</i> Portofolio .....	96
Tabel 4.16 Perhitungan Risiko Portofolio .....	97