

## DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Data Rata-rata <i>Return</i> Saham Indeks LQ 45.....	2
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	34
Tabel 3.1 Sampel Pembentuk Indeks LQ45 .....	38
Tabel 3.2 Definisi Operasional Variabel.....	42
Table 4.1 Sampel Penelitian.....	51
Tabel 4.2 Uji Normalitas Data Return Saham .....	68
Tabel 4.3 <i>Return</i> Ekspektasi dan Risiko Saham Individual.....	71
Tabel 4.4 <i>Return</i> dan Risiko Pasar.....	73
Tabel 4.5 Beta dan Alpha Sekuritas.....	76
Tabel 4.6 Perhitungan Varian Kesalahan Residu dari 14 saham LQ-45.....	78
Tabel 4.7 Perhitungan <i>Excess Return to Beta</i> (ERB).....	81
Tabel 4.8 Nilai ERB dengan Ci masing-masing saham.....	84
Tabel 4.9 Proporsi Saham dalam Portofolio Optimal .....	86
Tabel 4.10 Perhitungan <i>Return</i> Portofolio .....	88
Tabel 4.11 Diversifikasi Portofolio.....	89
Tabel 4.10 Hasil Diversifikasi.....	96