

## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Penelitian Terdahulu .....	32
Tabel 4.1 Sampel Penelitian.....	40
Tabel 4.2 Sumber Data Penelitian.....	41
Tabel 4.3 Matriks Kovarians.....	47
Tabel 5.1 Ekspektasi Imbal Hasil, Deviasi Standar, dan Beta .....	62
Tabel 5.2 Kovarians Emiten.....	65
Tabel 5.3 Titik Portofolio Penyusun Kurva .....	68
Tabel 5.4 Nilai $ERB_i$ dari setiap emiten.....	75
Tabel 5.5 <i>Variance Error</i> , Variabel $A_i$ , $B_i$ , dan $C_i$ .....	75
Tabel 5.6 Kandidat Portofolio Optimal.....	76
Tabel 5.7 Bobot Penyusun Portofolio Optimal.....	77
Tabel 5.8 Rasio Sharpe dari Portofolio dan Pasar.....	79
Tabel 5.9 Rasio Treynor dari Portofolio dan Pasar .....	81
Tabel 5.10 Rasio Jensen dari Portofolio dan Pasar .....	83
Tabel 5.11 Simulasi Investasi Model Markowitz .....	84
Tabel 5.12 Simulasi Investasi Model Indeks Tunggal.....	85

UNIVERSITAS  
MERCU BUANA