

## DAFTAR RUMUS

Rumus	Halaman
2.1 Beta saham .....	35
2.2 Beta portofolio .....	35
2.3 Persamaan regresi linier sederhana .....	37
2.4 Standar deviasi .....	38
2.5 Varian <i>return</i> sekuritas .....	39
2.6 Kovarian <i>return</i> saham .....	40
2.7 ERB .....	40
2.8 <i>Cut off point</i> .....	42
3.1 <i>Return</i> saham individu .....	56
3.2 <i>Return</i> ekspektasi saham individu .....	56
3.3 Risiko saham individu .....	57
3.4 <i>Return</i> pasar .....	57
3.5 <i>Return</i> ekspektasi pasar .....	57
3.6 Risiko pasar .....	57
3.7 Beta saham .....	58
3.8 Alpha saham .....	58
3.9 Kesalahan residu .....	58
3.10 Varian kesalahan residu .....	58
3.11 <i>Excess Return to Beta</i> .....	58
3.12 $A_i$ .....	59
3.13 $B_i$ .....	59
3.14 <i>Cut off point</i> .....	59
3.15 Proporsi saham .....	60
3.16 $Z_i$ .....	60
3.17 Beta portofolio .....	60
3.18 Alpha portofolio .....	61
3.19 <i>Return</i> ekspektasi portofolio .....	61
3.18 Risiko portofolio .....	61