

DAFTAR RUMUS

Rumus	Halaman
2.1 <i>Price Earning Ratio</i> (PER)	17
2.2 R Teoritis.....	17
2.3 R Aktual	17
2.4 <i>Return Total</i>	19
2.5 <i>Capital Gain</i> atau <i>Capital Loss</i>	19
2.6 <i>Return</i> Ekspektasi.....	19
2.7 <i>Return</i> Pasar	19
2.8 <i>Return</i> Ekspektasi Pasar	20
2.9 Varian Saham	20
2.10 Standar Deviasi	21
2.11 Kovarian	23
2.12 Kovarian Saham	24
2.13 <i>Return</i> Portofolio.....	27
2.14 Risiko Portofolio	27
2.15 Risiko Portofolio	28
2.16 <i>Return</i> Ekspektasi Model <i>Black-Litterman</i>	30
2.17 <i>Return</i> Ekspektasi Model <i>Black-Litterman</i>	31
2.18 Persamaan CAPM	33
2.19 Beta Saham.....	34
2.20 Beta Saham.....	34
2.21 <i>Implied Equilibrium Return</i>	35
2.22 Indeks <i>Treynor</i>	38
2.23 Indeks <i>Sharpe</i>	39
2.24 Indeks <i>Jensen</i>	39
3.1 <i>Return</i> Ekspektasi Saham CAPM	55
3.2 <i>Return</i> Saham Individu	56
3.3 <i>Return</i> Ekspektasi Saham Individu	56
3.4 Risiko Saham Individu	56
3.5 <i>Return</i> Pasar	57
3.6 <i>Return</i> Ekspektasi Pasar	57
3.7 Risiko Pasar.....	57
3.8 Beta Saham.....	58
3.9 Pembobotan Model <i>Black-Litterman</i>	59
3.10 Kelebihan <i>Return</i> Ekspektasi Model <i>Black-Litterman</i>	59
3.11 Parameter.....	60

3.12	<i>Implied Equilibrium Return</i>	60
3.13	<i>Risk Aversion Coefficient</i>	60
3.14	<i>Market Capitalization Weight</i>	61
3.15	Kovarian Saham	61
3.16	PER	61
3.17	Omega	62
3.18	<i>Return Ekspektasi Portofolio</i>	63
3.19	Risiko Portofolio	63
3.20	Indeks Sharpe	64