

PERHITUNGAN RESIKO DAN RETURN PORTFOLIO MODEL INDEKS TUNGGAL

Emiten	Bobot (Xi)	Alpha (ai)	Alpha P (ap)	Beta (βi,m)	Beta (βp)	Var.εi,m	(XiXij)Var.εi	Rm	Var Rm
BNBR	0.02874	1.98800	0.05713	0.89936	0.02585	470.583	0.38664	0.118	1.930
MBAJ	0.04691	0.45600	0.02139	0.30864	0.01448	80.653	0.13346	0.118	1.930
BUMI	0.04875	0.68100	0.03320	0.49497	0.02413	89.304	0.21247	0.118	1.930
SMRA	0.07388	0.65900	0.04869	0.67283	0.04232	58.304	0.30735	0.118	1.930
BBLD	0.07147	0.76100	0.05439	0.67283	0.04810	67.639	0.34553	0.118	1.930
SAFE	0.04108	0.50800	0.02087	0.54634	0.02285	74.909	0.12654	0.118	1.930
META	0.02545	0.38700	0.00985	0.44951	0.01144	113.935	0.07379	0.118	1.930
BIPP	0.02664	0.88800	0.02365	1.10323	0.07839	206.909	0.14682	0.118	1.930
SIPO	0.02923	0.58500	0.01710	0.83949	0.02746	162.004	0.13840	0.118	1.930
ELTY	0.02536	0.77300	0.01960	1.32824	0.03368	179.893	0.11565	0.118	1.930
SMAR	0.18015	0.27900	0.05026	0.44323	0.02487	188.873	0.08211	0.118	1.930
GDWU	0.02032	0.69200	0.01406	0.93178	0.02488	99.981	0.07126	0.118	1.930
JKSW	0.02670	0.47900	0.01279	0.85686	0.06324	29.668	0.16109	0.118	1.930
BRPT	0.07381	0.40500	0.02969	1.11327	0.02336	105.069	0.04623	0.118	1.930
POLY	0.02098	0.42800	0.00898	0.83533	0.06261	21.408	0.12027	0.118	1.930
UNSP	0.07486	0.32300	0.02421	0.70964	0.00723	104.141	0.01080	0.118	1.930
MYRX	0.01018	0.23723	0.00242	0.70964	0.00723	126.071	0.01452	0.118	1.930
ALDI	0.01073	0.30200	0.00324	1.01506	0.01089	19.387	0.05462	0.118	1.930
TINS	0.05311	0.25400	0.01349	0.98454	0.05229	11.102	0.00171	0.118	1.930
BBIA	0.01240	0.07000	0.00087	0.19161	0.00236	48.534	0.00515	0.118	1.930
MIRA	0.01031	0.17000	0.00175	0.94824	0.00874	16.690	0.01605	0.118	1.930
LSIP	0.03288	0.19300	0.00635	1.06055	0.03488	11.408	0.01468	0.118	1.930
MYOR	0.03588	0.17000	0.00810	1.00342	0.03600	35.231	0.00206	0.118	1.930
LPBN	0.00764	0.15100	0.00115	1.01011	0.00772	13.827	0.00211	0.118	1.930
KLBF	0.01245	0.17100	0.00213	1.46528	0.01824	2.86366	0.00211	0.118	1.930
	1	0.48356		0.73887					

PERHITUNGAN RETURN PORTFOLIO

Emiten	Xi	Ri	XiRi
BNBR	0.02874	2.094	0.06018
MBAJ	0.04691	0.492	0.02308
BUMI	0.04875	0.739	0.03603
SMRA	0.07388	0.727	0.05371
BBLD	0.07147	0.840	0.06004
SAFE	0.04108	0.573	0.02354
META	0.02545	0.440	0.01120
BIPP	0.02664	1.018	0.02712
SIPO	0.02923	0.696	0.02034
ELTY	0.02536	0.929	0.02356
SMAR	0.18015	0.331	0.05963
GDWU	0.02032	0.836	0.01699
JKSW	0.02670	0.589	0.01572
BRPT	0.07381	0.506	0.03735
POLY	0.02098	0.559	0.01173
UNSP	0.07486	0.422	0.03163
MYRX	0.01018	0.321	0.00327
ALDI	0.01073	0.421	0.00452
TINS	0.05311	0.370	0.01985
BBIA	0.01240	0.092	0.00114
MIRA	0.01031	0.270	0.00278
LSIP	0.03288	0.318	0.01046
MYOR	0.03588	0.288	0.01033
LPBN	0.00764	0.270	0.00208
KLBF	0.01245	0.344	0.00428
	1		0.57033