

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
1.1 Contoh perhitungan <i>return</i> dan risiko saham	4
1.2 Transaksi dan indeks saham di bursa efek	6
2.1 Instrumen pasar modal di Indonesia	17
2.2 <i>Mapping</i> penelitian terdahulu	44
3.1 Saham pembentukan <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) yang bertahan selama periode Juni 2010-November 2013	49
3.2 Ringkasan definisi operasional dan variabel penelitian	55
4.1 Sampel penelitian	62
4.2 <i>Return</i> Ekspektasi dan risiko saham individu pada 15 saham JII	79
4.3 <i>Return</i> Pasar dan Risiko Pasar	80
4.4 Beta dan alpha saham individu pada saham JII	81
4.5 Varian kesalahan residu (ϵ_i^2) pada saham JII	84
4.6 <i>Excess Return to Beta</i> (ERB) pada 15 saham JII	85
4.7 Nilai <i>cut off point</i> (Ci) pada 15 saham JII	87
4.8 Proporsi saham kombinasi portofolio optimal	88
4.9 Beta portofolio, alpha portofolio dan <i>return</i> ekspektasi portofolio	89
4.10 Risiko portofolio	90
4.11 <i>Return</i> dan risiko saham individu dan portofolio	102