

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
1.1 Return Saham	2
2.1 Penelitian Terdahulu	26
3.1 Daftar Saham Syariah pada <i>Jakarta Islamic Index</i>	32
3.2 Definisi Operasional Variabel	35
3.3 Nilai Koefisien Determinasi (R^2)	38
4.1 Hasil Uji Stasioneritas <i>correlogram</i> pada tingkat <i>level</i> ...	52
4.2 Hasil Estimasi Model AR (1)	55
4.3 Hasil Estimasi Model MA (1)	56
4.4 Hasil Estimasi Model ARMA (1,1)	57
4.5 Rekapitulasi Nilai Koefisien determinasi (R^2) dan AIC	58
4.6 <i>Correlogram of Residuals</i> ARMA (1,1)	59
4.7 <i>Correlogram of Residuals Squared</i>	61
4.8 Hasil Uji Heteroskedastisitas	62
4.9 Estimasi Model ARCH	63
4.10 Estimasi Model GARCH	64
4.11 <i>Correlogram of Residuals</i>	66
4.12 Hasil uji ARCH-LM	67