

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Daftar Saham yang Masuk dalam Penghitungan <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) Periode Desember 2013 s.d. Mei 2014 (Lamp. Pengumuman No. Peng-00673/BELPSH/11-2013 tanggal 28 November 2013).....	14
Tabel 2.2	Daftar Saham yang Masuk dalam Penghitungan <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) Periode Juni s.d. November 2014 (Lamp. Pengumuman No. Peng-00235/BELOPP/05-2014 tanggal 28 Mei 2014).....	15
Tabel 2.3	Daftar Saham yang Masuk dalam Penghitungan <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) Periode Desember 2014 s.d. Mei 2015 (Lamp. Pengumuman No. Peng-00837/BELOPP/11-2014 tanggal 27 November 2014).....	16
Tabel 2.4	Daftar Saham yang Masuk dalam Penghitungan <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) Periode Juni s.d. November 2015 (Lamp. Pengumuman No. Peng-00343/BELOPP/05-2015 tanggal 28 Mei 2015) .....	17
Tabel 2.5	Daftar Saham yang Masuk dalam Penghitungan <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) Periode Desember 2015 s.d. Mei 2016 (Lamp. Pengumuman No. Peng-00955/BELOPP/11-2015 tanggal 21 November 2015).....	18
Tabel 3.1	Kelebihan dan Kekurangan Metode Pengukuran VaR.....	35

Tabel 3.2 Penelitian Terdahulu (Jurnal Nasional) .....	50
Tabel 3.3 Penelitian Terdahulu (Jurnal Interntional).....	53
Tabel 4.1 Daftar Saham – Saham yang konsisten secara berturut-turut masuk kedalam kategori Jakarta Islamic Index periode 1 Januari 2014 s/d 31 Desember 2015.....	60
Tabel 5.1 Return Saham AALI, ADRO, AKRA, ASII, ASRI, BSDE dan ICBP.....	69
Tabel 5.2 Return Saham INDF, INTF, ITMG, KBLF, LPKR, LSIP dan MPPA.....	70
Tabel 5.3 Return Saham PGAS, SMGR, SMRA, TLKM, UNTR, UNVR, WIKA, JII, dan LQ45.....	70
Tabel 5.4 Hasil Pengujian ADF Test untuk <i>Return</i> saham AALI.....	71
Tabel 5.5 Hasil Pengujian ADF Test <i>Return</i> saham.....	72
Tabel 5.6 Hasil Pengujian Normalitas <i>Return</i> saham.....	74
Tabel 5.7 Hasil Perhitungan <i>Cornish Fisher Expansion</i> .....	75
Tabel 5.8 Hasil Pengujian <i>White Heteroskedastic Data Return</i> Saham AALI .....	77
Tabel 5.9 Hasil Pengujian <i>White Test Heteroskedastic Return Saham</i> .....	78
Tabel 5.10 Hasil Pengujian <i>Heteroskedastic Return Saham</i> .....	78
Tabel 5.11 Hasil Pengujian <i>Homoskedastic Return Saham</i> .....	79
Tabel 5.12 Hasil <i>Decay Factor Optimum Return Saham</i> .....	80

Tabel 5.13 Perhitungan VaR harian <i>Return</i> Saham AALI dengan Model Volatilitas EWMA periode 1 Desember 2015 sampai dengan 31 Desember 2015.....	81
Tabel 5.14 Hasil Perhitungan VaR Harian Model Volatilitas EWMA Periode 1 Bulan, 3 Bulan, 6 Bulan.....	83
Tabel 5.15 Model ARCH/GARCH terbaik untuk semua <i>return</i> .....	88
Tabel 5.16 Perhitungan VaR harian <i>Return</i> Saham AALI dengan Model Volatilitas ARCH periode 1 Desember 2015 sampai dengan 31 Desember 2015.....	91
Tabel 5.17 Hasil Perhitungan VaR Harian dengan Model Volatilitas ARCH Periode 1 Bulan, 3 Bulan, 6 Bulan.....	92
Tabel 5.18 Perhitungan VaR harian <i>Return</i> Saham AALI dengan Model Volatilitas GARCH periode 1 Desember 2015 sampai dengan 31 Desember 2015.....	95
Tabel 5.19 Hasil Perhitungan VaR Harian dengan Model Volatilitas GARCH Periode 1 Bulan, 3 Bulan, 6 Bulan.....	96
Tabel 5.20 Perhitungan VaR harian <i>Return</i> Saham WIKA dengan Model Volatilitas Konstan periode 1 Desember 2015 sampai dengan 31 Desember 2015.....	100
Tabel 5.21 Hasil Perhitungan VaR Harian dengan Model Volatilitas Konstan Periode 1 Bulan, 3 Bulan, 6 Bulan.....	101