

Lampiran 1. Tingkat Keuntungan Masing-Masing Saham Jakarta Islamic Indeks Tahun 2015

Bulan	AALI	ADRO	AKRA	ASII	ASRI	BSDE	ICBP	INCO	INDF	INTP
Januari	-0,0412	-0,0385	0,1396	0,0572	0,0625	0,1191	0,1069	-0,0483	0,1185	-0,0800
Februari	0,0602	-0,0400	0,0373	0,0000	0,1261	0,0990	-0,0138	0,0217	-0,0199	0,0457
Maret	-0,0142	-0,0104	0,0524	0,0924	-0,1716	-0,0383	0,0262	-0,0823	0,0068	-0,0884
April	-0,1626	-0,0789	0,0146	-0,2012	0,1081	-0,1265	-0,1005	-0,1360	-0,0940	-0,0422
Mei	0,2187	-0,0171	0,0529	0,0657	-0,0244	0,0214	0,0682	0,1163	0,0815	0,0667
Juni	-0,0746	-0,1163	0,0822	-0,0308	-0,0417	-0,1234	-0,1152	-0,1314	-0,0993	-0,0681
Juli	-0,1253	-0,2237	-0,0295	-0,0601	-0,1217	0,0719	-0,0140	-0,2768	-0,0722	-0,0407
Agustus	-0,1469	0,0085	0,0565	-0,1090	-0,2990	-0,1034	0,0366	-0,2117	-0,1311	-0,0200
September	0,0584	-0,1008	-0,0370	-0,1181	-0,1073	-0,1246	-0,0275	0,4142	0,0377	-0,1618
Oktober	0,0979	0,1121	0,0085	0,1292	-0,4019	0,1530	0,0645	0,0229	0,0045	0,0942
November	-0,1482	-0,0756	0,0339	0,0042	0,7937	0,0401	-0,0436	-0,2640	-0,1176	0,0389
Desember	0,0560	-0,0091	0,0205	0,0759	0,0649	0,0326	0,0297	-0,0152	0,0718	0,0922

Bulan	ITMG	KLBF	LPKR	LSIP	MPPA	PGAS	PTPP	SILO	SMGR	SMRA
Januari	0,0894	0,0191	0,1127	-0,0265	0,2459	-0,1583	0,0951	-0,0219	-0,1003	0,0855
Februari	0,0090	-0,0322	0,0396	0,0217	0,1000	0,0297	0,0370	-0,0877	0,0206	0,1000
Maret	0,0000	0,0332	0,1441	-0,0798	-0,0526	-0,0769	-0,0653	0,0961	-0,0824	-0,0523
April	-0,2544	-0,0375	-0,1222	-0,1763	0,0000	-0,1458	0,0343	0,0597	-0,0842	0,0349
Mei	0,0714	0,0251	0,0970	0,1684	-0,0783	0,0476	0,0242	-0,0070	0,0760	0,1096
Juni	-0,0481	-0,0897	-0,0923	-0,0661	-0,1918	0,0047	-0,1368	0,0213	-0,1078	-0,1722
Juli	-0,2432	0,0418	-0,0212	-0,1286	-0,0169	-0,0730	0,1254	0,1493	-0,1583	0,0642
Agustus	-0,0386	-0,0401	-0,0736	-0,2030	-0,1379	-0,3050	-0,1524	-0,0876	-0,0842	-0,0690
September	0,0561	-0,1791	0,0561	0,2824	-0,2320	-0,0899	0,0468	-0,1805	-0,0216	-0,3086
Oktober	-0,1418	0,0400	0,0531	0,1191	0,1693	0,1858	0,0996	-0,1192	0,0829	0,2455
November	-0,2035	-0,0664	0,0798	-0,2258	-0,1648	-0,1150	-0,0486	-0,1422	0,0842	0,1111
Desember	-0,0407	0,0412	0,0584	0,0417	0,0213	0,0264	0,0124	0,0348	0,0376	0,0065

Bulan	SSMS	TLKM	UNTR	UNVR	WIKA
Januari	-0,0090	-0,0122	0,0317	0,1091	0,0177
Februari	0,2030	0,0371	0,1592	0,0049	-0,0227
Maret	0,0025	-0,0153	0,0506	0,1014	-0,0451
April	-0,0452	-0,0952	-0,0183	0,0744	-0,1459
Mei	0,2368	0,0880	-0,0514	0,0164	0,0519
Juni	-0,2149	0,0299	0,0037	-0,0878	-0,2022
Juli	0,0650	0,0034	-0,0086	0,0127	0,0599
Agustus	-0,1781	-0,0238	-0,0532	-0,0069	0,0414
September	0,0000	-0,0784	-0,0863	-0,0434	-0,0633
Oktober	0,1765	0,0132	0,0358	-0,0263	0,1351
November	-0,1684	0,0933	-0,0994	-0,0068	-0,0425
Desember	0,0000	0,0034	0,0000	0,0177	0,0178

Data: Diolah 2016

Lampiran 2
Tingkat keuntungan yang diharapkan atau expected return
Saham Jakarta Islamic Indeks tahun 2015

Kode perusahaan	E(Ri)
AAI	-0,0185
ADRO	-0,0492
AKRA	0,0360
ASII	-0,0079
ASRI	-0,0010
BSDE	0,0017
ICBP	0,0014
INCO	-0,0492
INDF	-0,0177
INTP	-0,0136
ITMG	-0,0620
KLBF	-0,0203
LPKR	0,0276
LSIP	-0,0227
MPPA	-0,0281
PGAS	-0,0558
PTPP	0,0059
SILO	-0,0237
SMGR	-0,0281
SMRA	0,0129
SSMS	0,0056
TLKM	0,0036
UNTR	-0,0030
UNVR	0,0137
WIKA	-0,0165

Data : diolah 2016

Lampiran 3
Alpha dan Beta
Saham Jakarta Islamic Indeks tahun 2015

Kode perusahaan	A	β
AALI	1,6633	0,0080
ADRO	0,9759	0,0104
AKRA	0,1731	0,0020
ASII	2,0224	0,0016
ASRI	0,061	0,0812
BSDE	1,9817	0,0023
ICBP	0,9961	0,0023
INCO	0,3802	0,0325
INDF	1,0637	0,0045
INTP	1,1985	0,0034
ITMG	0,6317	0,0127
KLBF	1,0082	0,0091
LPKR	1,4026	0,0031
LSIP	1,082	0,0203
MPPA	2,0318	0,0121
PGAS	1,8357	0,0082
PTPP	0,7998	0,0062
SILO	-0,122	0,0094
SMGR	1,1372	0,0043
SMRA	2,3156	0,01
SSMS	2,2014	0,0112
TLKM	0,7337	0,0019
UNTR	0,7474	0,0034
UNVR	0,277	0,0029
WIKA	1,3455	0,0045

Data : diolah 2016

Lampiran 4
Risiko tidak sistematis
Saham Jakarta Islamic Indeks tahun 2015

Kode perusahaan	σ^2_{ei}
AALI	0,0080
ADRO	0,0104
AKRA	0,0020
ASII	0,0016
ASRI	0,0812
BSDE	0,0023
ICBP	0,0023
INCO	0,0325
INDF	0,0045
INTP	0,0034
ITMG	0,0127
KLBF	0,0091
LPKR	0,0031
LSIP	0,0203
MPPA	0,0121
PGAS	0,0082
PTPP	0,0062
SILO	0,0094
SMGR	0,0043
SMRA	0,01
SSMS	0,0112
TLKM	0,0019
UNTR	0,0034
UNVR	0,0029
WIKA	0,0045

Data : diolah 2016

Lampiran 5
Excess Return to Beta (ERB)
saham Jakarta Islamic Indeks tahun 2015

	ERB
AALI	-0,38388
ADRO	-0,68573
AKRA	-3,37377
ASII	-0,31047
ASRI	-10,1803
BSDE	-0,312
ICBP	-0,62102
INCO	-1,76013
INDF	-0,59951
INTP	-0,52866
ITMG	-1,07963
KLBF	-0,63509
LPKR	-0,42236
LSIP	-0,59399
MPPA	-0,31898
PGAS	-0,36814
PTPP	-0,76782
SILO	5,27623
SMGR	-0,56991
SMRA	-0,26218
SSMS	-0,2791
TLKM	-0,84013
UNTR	-0,83356
UNVR	-2,18881
WIKA	-0,47306

Data : Diolah 2016

Lampiran 6
 Nilai Ai Bi dan Ci
 Saham Jakarta Islamic Indeks tahun 2015

	Ai	Bi	Ci
AALI	-47,9844	345,8209	-0,05673
ADRO	-65,9352	91,57508	-0,11146
AKRA	-1686,89	14,98181	-3,27562
ASII	-194,045	2556,314	-0,06349
ASRI	-125,373	0,045825	-0,25072
BSDE	-135,654	1707,45	-0,06145
ICBP	-270,01	431,3979	-0,2899
INCO	-54,1577	4,447755	-0,10736
INDF	-133,225	251,435	-0,17729
INTP	-155,488	422,4713	-0,16856
ITMG	-85,01	31,42086	-0,15997
KLBF	-69,7904	111,6997	-0,11409
LPKR	-136,245	634,6086	-0,12008
LSIP	-29,2607	57,67113	-0,05247
MPPA	-26,3618	341,1745	-0,03134
PGAS	-44,8955	410,9505	-0,04928
PTPP	-123,841	103,1742	-0,20532
SILO	561,301	1,583404	1,119058
SMGR	-132,537	300,7497	-0,16552
SMRA	-26,2178	536,2003	-0,0253
SSMS	-24,9192	432,693	-0,02672
TLKM	-442,171	283,324	-0,56448
UNTR	-245,164	164,2961	-0,36906
UNVR	-754,762	26,45828	-1,43366
WIKA	-105,124	402,3045	-0,11651

Data : diolah 2016