

LAMPIRAN

Lampiran 1 Perusahaan yang tercatat di Index IDX 30

No	KODE	NAMA PERUSAHAAN
1	<u>ADHI</u>	Adhi Karya (Persero) Tbk
2	<u>ADRO</u>	Adaro Energy Tbk
3	<u>AKRA</u>	AKR Corporindo Tbk *)
4	<u>ASII</u>	Astra International Tbk
5	<u>ASRI</u>	Alam Sutera Realty Tbk *)
6	<u>BBCA</u>	Bank Central Asia Tbk
7	<u>BBNI</u>	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk
8	<u>BBRI</u>	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk
9	<u>BMRI</u>	Bank Mandiri (Persero) Tbk
10	<u>BSDE</u>	Bumi Serpong Damai Tbk
11	<u>CPIN</u>	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
12	<u>GGRM</u>	Gudang Garam Tbk
13	<u>ICBP</u>	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk
14	<u>INDF</u>	Indofood Sukses Makmur Tbk
15	<u>INTP</u>	Indocement Tunggul Prakasa Tbk
16	<u>KLBF</u>	Kalbe Farma Tbk
17	<u>LPKR</u>	Lippo Karawaci Tbk
18	<u>LPPF</u>	Matahari Department Store Tbk
19	<u>MNCN</u>	Media Nusantara Citra Tbk
20	<u>MPPA</u>	Matahari Putra Prima Tbk
21	<u>PGAS</u>	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk
22	<u>PWON</u>	Pakuwon Jati Tbk
23	<u>SCMA</u>	Surya Citra Media Tbk
24	<u>SMGR</u>	Semen Indonesia (Persero) Tbk
25	<u>SMRA</u>	Summarecon Agung Tbk
26	<u>SSMS</u>	Sawit Sumbermas Sarana Tbk
27	<u>TLKM</u>	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk
28	<u>UNTR</u>	United Tractors Tbk
29	<u>UNVR</u>	Unilever Indonesia Tbk
30	<u>WIKA</u>	Wijaya Karya (Persero) Tbk

Lampiran 2 Perhitungan Return saham

Periode	Harga Saham ASII	Return	Harga Saham KLBF	Return	Harga Saham ICBP	Return	Harga Saham UNTR	Return	Harga Saham LPKR	Return
	7,400.00		1530		17225		14800		1145	
01/07/16	7,250.00	-0,0203	1515	-0,0098	16950	-0,0160	14800	0,0000	1150	0,0044
11/07/16	7,250.00	0,0000	1605	0,0594	17425	0,0280	15075	0,0186	1170	0,0174
12/07/16	7,275.00	0,0034	1585	-0,0125	17400	-0,0014	15500	0,0282	1170	0,0000
13/07/16	7,100.00	-0,0241	1590	0,0032	17350	-0,0029	16150	0,0419	1200	0,0256
14/07/16	7,100.00	0,0000	1570	-0,0126	17000	-0,0202	15600	-0,0341	1170	-0,0250
15/07/16	7,250.00	0,0211	1570	0,0000	17000	0,0000	15500	-0,0064	1170	0,0000
18/07/16	7,325.00	0,0103	1595	0,0159	16925	-0,0044	16000	0,0323	1150	-0,0171
19/07/16	7,450.00	0,0171	1590	-0,0031	17125	0,0118	16200	0,0125	1185	0,0304
20/07/16	7,375.00	-0,0101	1610	0,0126	17450	0,0190	16000	-0,0123	1175	-0,0084
21/07/16	7,350.00	-0,0034	1565	-0,0280	17200	-0,0143	15900	-0,0063	1155	-0,0170
22/07/16	7,500.00	0,0204	1595	0,0192	17375	0,0102	15850	-0,0031	1155	0,0000
25/07/16	7,450.00	-0,0067	1665	0,0439	17550	0,0101	16000	0,0095	1160	0,0043

26/07/16	7,375.00	-0,0101	1675	0,0060	17900	0,0199	15700	-0,0188	1150	-0,0086
27/07/16	7,425.00	0,0068	1710	0,0209	9000	-0,4972	15400	-0,0191	1150	0,0000
28/07/16	7,725.00	0,0404	1710	0,0000	8850	-0,0167	15625	0,0146	1145	-0,0043
29/07/16	8,000.00	0,0356	1675	-0,0205	8600	-0,0282	15750	0,0080	1135	-0,0087
01/08/16	7,975.00	-0,0031	1700	0,0149	8925	0,0378	16150	0,0254	1170	0,0308
02/08/16	7,950.00	-0,0031	1685	-0,0088	8800	-0,0140	16250	0,0062	1140	-0,0256
03/08/16	7,750.00	-0,0252	1690	0,0030	8800	0,0000	16300	0,0031	1155	0,0132
04/08/16	7,925.00	0,0226	1695	0,0030	8850	0,0057	17600	0,0798	1190	0,0303
05/08/16	8,325.00	0,0505	1715	0,0118	8925	0,0085	17300	-0,0170	1180	-0,0084
08/08/16	8,125.00	-0,0240	1720	0,0029	8825	-0,0112	17425	0,0072	1165	-0,0127
09/08/16	8,125.00	0,0000	1710	-0,0058	8750	-0,0085	17150	-0,0158	1160	-0,0043
10/08/16	8,125.00	0,0000	1690	-0,0117	8750	0,0000	17900	0,0437	1170	0,0086
11/08/16	7975	-0,0185	1705	0,0089	8725	-0,0029	18050	0,0084	1165	-0,0043
12/08/16	7,850.00	-0,0157	1710	0,0029	8600	-0,0143	17700	-0,0194	1170	0,0043
15/08/16	7,875.00	0,0032	1685	-0,0146	8650	0,0058	17900	0,0113	1150	-0,0171
16/08/16	8,300.00	0,0540	1700	0,0089	8725	0,0087	17750	-0,0084	1150	0,0000

18/08/16	8,100.00	-0,0241	1715	0,0088	9200	0,0544	17500	-0,0141	1170	0,0174
19/08/16	8,300.00	0,0247	1700	-0,0087	9025	-0,0190	16800	-0,0400	1155	-0,0128
22/08/16	8,100.00	-0,0241	1720	0,0118	9250	0,0249	17275	0,0283	1160	0,0043
23/08/16	8,200.00	0,0123	1815	0,0552	9350	0,0108	17500	0,0130	1155	-0,0043
24/08/16	8,400.00	0,0244	1755	-0,0331	9300	-0,0053	17775	0,0157	1145	-0,0087
25/08/16	8,350.00	-0,0060	1800	0,0256	9625	0,0349	18000	0,0127	1160	0,0131
26/08/16	8,075.00	-0,0329	1785	-0,0083	9775	0,0156	17700	-0,0167	1150	-0,0086
29/08/16	8,075.00	0,0000	1780	-0,0028	9500	-0,0281	17600	-0,0056	1115	-0,0304
30/08/16	8,150.00	0,0093	1780	0,0000	9700	0,0211	18700	0,0625	1140	0,0224
Rata-rata		0,0028		0,0044		-0,0092		0,0065		-0,0009

*** Data Lengkap Ada Pada Peneliti

Lampiran 4 Perhitungan Return

Periode	Return ASII	Resiko	Return KLBF	Resiko	Return ICBP	Resiko	Return UNTR	Resiko	Return LPKR	Resiko
01/07/16	-0,0203	-0,0231	-0,0098	-0,0142	-0,0160	-0,0068	0,0000	-0,0065	0,0044	0,0053
11/07/16	0,0000	-0,0028	0,0594	0,0550	0,0280	0,0372	0,0186	0,0120	0,0174	0,0183
12/07/16	0,0034	0,0006	-0,0125	-0,0169	-0,0014	0,0078	0,0282	0,0217	0,0000	0,0009
13/07/16	-0,0241	-0,0269	0,0032	-0,0012	-0,0029	0,0063	0,0419	0,0354	0,0256	0,0266
14/07/16	0,0000	-0,0028	-0,0126	-0,0170	-0,0202	-0,0110	-0,0341	-0,0406	-0,0250	-0,0241
15/07/16	0,0211	0,0183	0,0000	-0,0044	0,0000	0,0092	-0,0064	-0,0129	0,0000	0,0009
18/07/16	0,0103	0,0075	0,0159	0,0115	-0,0044	0,0048	0,0323	0,0257	-0,0171	-0,0162
19/07/16	0,0171	0,0142	-0,0031	-0,0075	0,0118	0,0210	0,0125	0,0060	0,0304	0,0314
20/07/16	-0,0101	-0,0129	0,0126	0,0082	0,0190	0,0282	-0,0123	-0,0189	-0,0084	-0,0075
21/07/16	-0,0034	-0,0062	-0,0280	-0,0323	-0,0143	-0,0051	-0,0063	-0,0128	-0,0170	-0,0161
22/07/16	0,0204	0,0176	0,0192	0,0148	0,0102	0,0194	-0,0031	-0,0097	0,0000	0,0009
25/07/16	-0,0067	-0,0095	0,0439	0,0395	0,0101	0,0193	0,0095	0,0029	0,0043	0,0052

26/07/16	-0,0101	-0,0129	0,0060	0,0016	0,0199	0,0291	-0,0188	-0,0253	-0,0086	-0,0077
27/07/16	0,0068	0,0039	0,0209	0,0165	-0,4972	-0,4880	-0,0191	-0,0256	0,0000	0,0009
28/07/16	0,0404	0,0376	0,0000	-0,0044	-0,0167	-0,0075	0,0146	0,0081	-0,0043	-0,0034
29/07/16	0,0356	0,0328	-0,0205	-0,0249	-0,0282	-0,0191	0,0080	0,0015	-0,0087	-0,0078
01/08/16	-0,0031	-0,0060	0,0149	0,0105	0,0378	0,0470	0,0254	0,0189	0,0308	0,0318
02/08/16	-0,0031	-0,0060	-0,0088	-0,0132	-0,0140	-0,0048	0,0062	-0,0003	-0,0256	-0,0247
03/08/16	-0,0252	-0,0280	0,0030	-0,0014	0,0000	0,0092	0,0031	-0,0035	0,0132	0,0141
04/08/16	0,0226	0,0197	0,0030	-0,0014	0,0057	0,0149	0,0798	0,0732	0,0303	0,0312
05/08/16	0,0505	0,0476	0,0118	0,0074	0,0085	0,0177	-0,0170	-0,0236	-0,0084	-0,0075
08/08/16	-0,0240	-0,0269	0,0029	-0,0015	-0,0112	-0,0020	0,0072	0,0007	-0,0127	-0,0118
09/08/16	0,0000	-0,0028	-0,0058	-0,0102	-0,0085	0,0007	-0,0158	-0,0223	-0,0043	-0,0034
10/08/16	0,0000	-0,0028	-0,0117	-0,0161	0,0000	0,0092	0,0437	0,0372	0,0086	0,0095
11/08/16	-0,0185	-0,0213	0,0089	0,0045	-0,0029	0,0063	0,0084	0,0018	-0,0043	-0,0034
12/08/16	-0,0157	-0,0185	0,0029	-0,0015	-0,0143	-0,0051	-0,0194	-0,0259	0,0043	0,0052
15/08/16	0,0032	0,0003	-0,0146	-0,0190	0,0058	0,0150	0,0113	0,0048	-0,0171	-0,0162
16/08/16	0,0540	0,0511	0,0089	0,0045	0,0087	0,0179	-0,0084	-0,0149	0,0000	0,0009

18/08/16	-0,0241	-0,0269	0,0088	0,0044	0,0544	0,0636	-0,0141	-0,0206	0,0174	0,0183
19/08/16	0,0247	0,0219	-0,0087	-0,0131	-0,0190	-0,0098	-0,0400	-0,0465	-0,0128	-0,0119
22/08/16	-0,0241	-0,0269	0,0118	0,0074	0,0249	0,0341	0,0283	0,0217	0,0043	0,0052
23/08/16	0,0123	0,0095	0,0552	0,0508	0,0108	0,0200	0,0130	0,0065	-0,0043	-0,0034
24/08/16	0,0244	0,0216	-0,0331	-0,0374	-0,0053	0,0038	0,0157	0,0092	-0,0087	-0,0077
25/08/16	-0,0060	-0,0088	0,0256	0,0212	0,0349	0,0441	0,0127	0,0061	0,0131	0,0140
26/08/16	-0,0329	-0,0358	-0,0083	-0,0127	0,0156	0,0248	-0,0167	-0,0232	-0,0086	-0,0077
29/08/16	0,0000	-0,0028	-0,0028	-0,0072	-0,0281	-0,0189	-0,0056	-0,0122	-0,0304	-0,0295
30/08/16	0,0093	0,0065	0,0000	-0,0044	0,0211	0,0302	0,0625	0,0560	0,0224	0,0233
Rata-rata	0,0028		0,0044		-0,0092		0,0065		-0,0009	

*** Data Lengkap Ada Pada Peneliti

Lampiran 4 Perhitungan Beta Regresi

RM-Rf	Ri-Rf (ICBP)	Beta ICBP	Ri-Rf (KLBF)	Beta KLBF	Ri-RF (TLKM)	Beta TLKM	Ri-RF (INCO)	Beta INCO
-0,0294	-0,0824	0,0024	-0,0923	0,0027	-0,0507	0,0015	-0,0513	0,0015
-0,0660	-0,0772	0,0051	-0,0659	0,0043	-0,0445	0,0029	-0,0798	0,0053
-0,0512	0,0053	-0,0003	0,0164	-0,0008	-0,0448	0,0023	-0,0951	0,0049
-0,1125	-0,0620	0,0070	-0,0984	0,0111	-0,0743	0,0084	-0,0663	0,0075
-0,0333	-0,0476	0,0016	0,0022	-0,0001	-0,0822	0,0027	-0,0600	0,0020
-0,0529	-0,0709	0,0037	-0,0797	0,0042	-0,0890	0,0047	-0,0610	0,0032
-0,0098	-0,0548	0,0005	-0,0295	0,0003	-0,0342	0,0003	-0,0729	0,0007
-0,0631	-0,0673	0,0042	-0,0270	0,0017	-0,0477	0,0030	-0,0567	0,0036
-0,0152	-0,0674	0,0010	-0,0721	0,0011	-0,0792	0,0012	-0,1004	0,0015
-0,0804	-0,0494	0,0040	-0,0791	0,0064	-0,0779	0,0063	-0,0761	0,0061
-0,1616	-0,0620	0,0100	-0,1176	0,0190	-0,0620	0,0100	-0,0641	0,0104
0,0001	-0,0460	0,0000	-0,0583	0,0000	-0,0539	0,0000	-0,0795	0,0000
-0,0214	-0,0533	0,0011	-0,0803	0,0017	-0,0684	0,0015	-0,0328	0,0007
-0,0561	-0,0516	0,0029	-0,0695	0,0039	-0,0604	0,0034	-0,0828	0,0046
-0,0331	-0,0569	0,0019	-0,0432	0,0014	-0,0329	0,0011	-0,0500	0,0017
-0,0245	-0,0859	0,0021	-0,0620	0,0015	-0,0557	0,0014	-0,0805	0,0020
-0,1080	-0,0340	0,0037	-0,0509	0,0055	-0,0558	0,0060	-0,0513	0,0055
-0,0389	-0,0484	0,0019	-0,0620	0,0024	-0,0480	0,0019	-0,0356	0,0014
-0,0550	-0,0654	0,0036	-0,0693	0,0038	-0,0651	0,0036	-0,0593	0,0033
0,0135	-0,0889	-0,0012	-0,0804	-0,0011	-0,0375	-0,0005	-0,0877	-0,0012
-0,2815	-0,0603	0,0170	-0,0545	0,0153	-0,0650	0,0183	-0,0539	0,0152
-0,0501	-0,0672	0,0034	-0,0880	0,0044	-0,0905	0,0045	-0,0582	0,0029
-0,0470	-0,0030	0,0001	-0,0773	0,0036	-0,0496	0,0023	-0,0658	0,0031

-0,0501	-0,0489	0,0024	-0,0310	0,0016	-0,0391	0,0020	-0,0515	0,0026
-0,0316	0,0124	-0,0004	-0,0432	0,0014	-0,0172	0,0005	-0,0772	0,0024
-0,0495	-0,0620	0,0031	-0,0620	0,0031	-0,0620	0,0031	-0,0799	0,0039
-0,1403	-0,1072	0,0150	-0,0805	0,0113	-0,0977	0,0137	-0,0934	0,0131
-0,0365	-0,0935	0,0034	-0,0658	0,0024	-0,0590	0,0022	-0,0465	0,0017
-0,1206	-0,0815	0,0098	-0,0658	0,0079	-0,0487	0,0059	-0,0707	0,0085
-0,0840	-0,0836	0,0070	-0,0696	0,0058	-0,1043	0,0088	-0,0463	0,0039
-0,1230	-0,0297	0,0037	-0,0620	0,0076	-0,0498	0,0061	-0,0674	0,0083
-0,1254	-0,0505	0,0063	-0,0696	0,0087	-0,0590	0,0074	-0,0544	0,0068
-0,0072	-0,0522	0,0004	-0,0812	0,0006	-0,0620	0,0004	-0,0451	0,0003
-0,0640	-0,0797	0,0051	-0,0502	0,0032	-0,0680	0,0043	-0,0860	0,0055
-0,0290	-0,0718	0,0021	-0,0814	0,0024	-0,0982	0,0029	-0,0558	0,0016
-0,0572	-0,0421	0,0024	-0,0580	0,0033	-0,0667	0,0038	-0,0735	0,0042
-0,0282	-0,0701	0,0020	-0,0305	0,0009	-0,0494	0,0014	-0,0715	0,0020
-0,0464	-0,0865	0,0040	-0,0620	0,0029	-0,0589	0,0027	-0,0535	0,0025
-0,0634	-0,0687	0,0044	-0,0925	0,0059	-0,0403	0,0026	-0,0190	0,0012
-0,0706	-0,0400	0,0028	-0,0581	0,0041	-0,0590	0,0042	-0,0470	0,0033
-0,0162	-0,0207	0,0003	-0,0424	0,0007	-0,0801	0,0013	-0,0606	0,0010
jumlah		0,14968		0,16613		0,15999		0,15872
Rata-rata		0,0037		0,0041		0,0039		0,0039

*** Data Lengkap Ada Pada Peneliti

Lampiran 4 Perhitungan Suku Bunga

Tabel 4.7 Suku Bunga

No	Tanggal	Suku Bunga
1	12-Jul-16	0.060
2	18-Agustu-16	0.065
Total		0.125
R _f		0.625

Lampiran 5 Perhitungan Beta

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.063	.005		-12.630	.000
	RM_SBI	-.065	.062	-.166	-1.048	.301

a. Dependent Variable: AALI_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.056	.008		-7.251	.000
	RM_SBI	-.028	.095	-.048	-.299	.767

a. Dependent Variable: ADRO_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.053	.006		-8.661	.000
	RM_SBI	.121	.075	.250	1.610	.115

a. Dependent Variable: AKRA_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.063	.005		-12.818	.000
	RM_SBI	-.058	.061	-.152	-.959	.344

a. Dependent Variable: ASII_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.057	.005		-12.447	.000
	RM_SBI	3.368E-005	.000	.070	.439	.663

a. Dependent Variable: ICBP_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.059	.004		-13.230	.000
	RM_SBI	8.871E-005	.000	.185	1.177	.246

a. Dependent Variable: KLBF_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.062	.003		-19.926	.000
	RM_SBI	2.577E-006	.000	.008	.049	.961

a. Dependent Variable: LPKR_SBI

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	-.062	.005		-13.219	.000
	RM_SBI	2.127E-005	.000	.043	.270	.789

a. Dependent Variable: PGAS_SBI

*** Data Lengkap Ada Pada Peneliti