

### Lampiran 01. Populasi Penelitian

No.	Kode perusahaan	Nama Saham
1	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
2	ASII	Astra Internasional Tbk.
3	BBCA	Bank Central Asia Tbk.
4	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.
5	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.
6	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.
7	GGRM	Gudang Garam Tbk.
8	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
9	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
10	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
11	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
12	PTBA	Bukit Asam Tbk.
13	PWON	Pakuwon Jati Tbk.
14	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.

Sumber : [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)



**Lampiran 02. Data Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks Saham MNC36 di Bursa Efek Indonesia**  
**Periode: 1 Mei 2018 – 31 Oktober 2018**




**Daftar Saham untuk Penghitungan Indeks MNC36**

**Periode Mei – Oktober 2018**


(Lampiran Pengumuman BEI No. Peng-00191/BEI.OPP/04-2018 tanggal 30 April 2018)

No.	Kode	Nama Saham	Keterangan
1.	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.	Baru
2.	ADRO	Adaro Energy Tbk.	Tetap
3.	ANTM	Aneka Tambang Tbk.	Baru
4.	ASH	Astra International Tbk.	Tetap
5.	BBCA	Bank Central Asia Tbk.	Tetap
6.	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
7.	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
8.	BBTN	Bank Tabungan Negara (Persero) Tbk.	Tetap
9.	BJBR	Bank Pembangunan Daerah Jawa Barat dan Banten Tbk.	Baru
10.	BJTM	Bank Pembangunan Daerah Jawa Timur Tbk.	Tetap
11.	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.	Tetap
12.	BRPT	Barito Pacific Tbk.	Tetap
13.	BSDE	Bumi Serpong Damai Tbk.	Tetap
14.	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.	Baru
15.	GGRM	Gudang Garam Tbk.	Tetap
16.	HMSP	H.M. Sampoerna Tbk.	Baru
17.	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.	Baru
18.	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.	Tetap
19.	INDY	Indika Energy Tbk.	Tetap
20.	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.	Baru
21.	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.	Tetap
22.	JSMR	Jasa Marga (Persero) Tbk.	Tetap
23.	KAEF	Kimia Farma Tbk.	Baru
24.	KLBF	Kalbe Farma Tbk.	Baru
25.	LPPF	Matahari Department Store Tbk.	Baru
26.	MEDC	Medco Energi Internasional Tbk.	Tetap
27.	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.	Tetap
28.	PGAS	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk.	Baru
29.	PTBA	Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk.	Tetap
30.	PTPP	PP (Persero) Tbk.	Tetap
31.	PWON	Pakuwon Jati Tbk.	Tetap
32.	TLKM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
33.	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.	Tetap
34.	UNTR	United Tractors Tbk.	Tetap
35.	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.	Baru
36.	WTON	Wijaya Karya Beton Tbk.	Baru

## Lampiran 03. Periode: 1 November 2018 – 31 April 2019



**IDX**  
Indonesia Stock Exchange  
wfe  
WORLD FEDERATION  
OF EXCHANGES



**IUK**  
Nabung Saham

**Daftar Saham untuk Penghitungan Indeks MNC36**  
**Periode November 2018 – April 2019**  
(Lampiran Pengumuman BEI No. Peng-00835/BEI.OPP/10-2018 tanggal 31 Oktober 2018)

No.	Kode	Nama Saham	Keterangan
1.	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.	Tetap
2.	ADRO	Adaro Energy Tbk.	Tetap
3.	ANTM	Aneka Tambang Tbk.	Tetap
4.	ASII	Astra International Tbk.	Tetap
5.	BBCA	Bank Central Asia Tbk.	Tetap
6.	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
7.	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
8.	BBTN	Bank Tabungan Negara (Persero) Tbk.	Tetap
9.	BDMN	Bank Danamon Indonesia Tbk.	Baru
10.	BJTM	Bank Pembangunan Daerah Jawa Timur Tbk.	Tetap
11.	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.	Tetap
12.	BNGA	Bank CIMB Niaga Tbk.	Baru
13.	BTPN	Bank Tabungan Pensiunan Nasional Tbk.	Baru
14.	GGRM	Gudang Garam Tbk.	Tetap
15.	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.	Tetap
16.	INDY	Indika Energy Tbk.	Tetap
17.	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.	Tetap
18.	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.	Tetap
19.	JFPA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.	Baru
20.	JSMR	Jasa Marga (Persero) Tbk.	Tetap
21.	KAEF	Kimia Farma Tbk.	Tetap
22.	KLBF	Kalbe Farma Tbk.	Tetap
23.	MAPI	Mitra Adiperkasa Tbk.	Baru
24.	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.	Tetap
25.	MYOR	Mayora Indah Tbk.	Baru
26.	PGAS	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk.	Tetap
27.	PTBA	Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk.	Tetap
28.	PWON	Pakuwon Jati Tbk.	Tetap
29.	SCMA	Surya Citra Media Tbk.	Baru
30.	SIDO	Industri Jamu dan Farmasi Sido Muncul Tbk.	Baru
31.	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.	Baru
32.	SSMS	Sawit Sumbermas Sarana Tbk.	Baru
33.	TLKM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
34.	UNTR	United Tractors Tbk.	Tetap
35.	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.	Tetap
36.	WSKT	Waskita Karya (Persero) Tbk.	Baru

Indonesia, PTSC (Persero) Tbk. Gedung, Tower L1, Floor 11, Jend. Sudirman No. 22, Jakarta 10120, Indonesia  
Phone: +62 21 515 0131 Fax: +62 21 515 0130 Toll Free: 800 100 2000 Email: [cs@idx.co.id](mailto:cs@idx.co.id)

Sumber: www.idx.co.id

## Lampiran 04. Periode: 1 Mei 2019 – 31 Oktober 2019



### Daftar Saham untuk Penghitungan Indeks MNC36 Periode Mei – Oktober 2019

(Lampiran Pengumuman BEI No. Peng-00992/BELPOP/04-2019 tanggal 26 April 2019)

No.	Kode	Nama Saham	Keterangan
1.	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.	Tetap
2.	AKRA	AKR Corporindo Tbk.	Baru
3.	ANTM	Aneka Tambang Tbk.	Tetap
4.	ASH	Astra International Tbk.	Tetap
5.	BBCA	Bank Central Asia Tbk.	Tetap
6.	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
7.	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
8.	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.	Tetap
9.	BNGA	Bank CIMB Niaga Tbk.	Tetap
10.	BNLI	Bank Permata Tbk.	Baru
11.	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk	Baru
12.	CTRA	Ciputra Development Tbk.	Baru
13.	GGRM	Gudang Garam Tbk.	Tetap
14.	HMSP	H.M. Sampoerna Tbk.	Baru
15.	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.	Tetap
16.	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.	Baru
17.	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.	Tetap
18.	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.	Tetap
19.	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.	Tetap
20.	KAEP	Kimia Farma Tbk.	Tetap
21.	KLBF	Kalbe Farma Tbk.	Tetap
22.	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.	Tetap
23.	MYOR	Mayora Indah Tbk.	Tetap
24.	NISP	Bank OCBC NISP Tbk.	Baru
25.	PGAS	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk.	Tetap
26.	PTBA	Bukit Asam Tbk.	Tetap
27.	PTPP	PP (Persero) Tbk.	Baru
28.	PWON	Pakuwon Jati Tbk.	Tetap
29.	SCMA	Surya Citra Media Tbk.	Tetap
30.	SIDO	Industri Jamu dan Farmasi Sido Muncul Tbk.	Tetap
31.	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.	Tetap
32.	TINS	Timah Tbk.	Baru
33.	UNTR	United Tractors Tbk.	Tetap
34.	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.	Tetap
35.	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.	Baru
36.	WSBP	Waskita Beton Precast Tbk.	Baru

www.idx.co.id

Indonesia Stock Exchange Building, Tower I, 6<sup>th</sup> Floor, Jl. Jend. Sudirman Kav.52-53 Jakarta 12190 - Indonesia  
Phone : +62 21 515 0515, Fax : +62 21 515 0330, Toll Free : 0800 100 9000, Email : callcenter@idx.co.id

Sumber: www.idx.co.id

## Lampiran 05. Periode: 1 November 2019 – 31 April 2020



**Daftar Saham untuk Penghitungan Indeks MNC36**  
**Periode November 2019 s.d. April 2020**  
 (Lampiran Pengumuman BEI No. Peng-00519/BEI/POP/10-2019 tanggal 25 Oktober 2019)

No.	Kode	Nama Saham	Keterangan
1.	ADRO	Adaro Energy Tbk.	Baru
2.	AKRA	AKR Corporindo Tbk.	
3.	ANTM	Aneka Tambang Tbk.	
4.	ASEI	Astra International Tbk.	
5.	BBCA	Bank Central Asia Tbk.	
6.	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	
7.	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.	
8.	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.	
9.	BNGA	Bank CIMB Niaga Tbk.	
10.	BNLI	Bank Permata Tbk.	
11.	BRPT	Barito Pacific Tbk.	Baru
12.	BSDE	Bumi Sepong Damai Tbk.	Baru
13.	CTRA	Cipta Development Tbk.	
14.	DMAS	Paradelta Lestari Tbk.	Baru
15.	EXCL	XL Axiata Tbk.	Baru
16.	GGRM	Gudang Garam Tbk.	
17.	HMSP	H.M. Sampoerna Tbk.	
18.	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.	
19.	INCO	Vale Indonesia Tbk.	Baru
20.	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.	
21.	KLBF	Kalbe Farma Tbk.	
22.	MAPI	Mitra Adiperkasa Tbk.	Baru
23.	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.	
24.	MYOR	Mayora Indah Tbk.	
25.	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.	
26.	PTBA	Bukit Asam Tbk.	
27.	PTPP	PT (Persero) Tbk.	
28.	PWON	Pakuwon Jati Tbk.	
29.	SIDO	Industri Jamu dan Farmasi Sido Muncul Tbk.	
30.	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.	
31.	SMRA	Summarecon Agung Tbk.	Baru
32.	TLKM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk.	Baru
33.	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.	Baru
34.	ULTJ	Ultra Jaya Milk Industry & Trading Company, Tbk.	Baru
35.	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.	
36.	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.	

www.idx.co.id

Indonesia Stock Exchange Building, Tower I, 6<sup>th</sup> Floor, Jl. Jend. Sudirman Kav.52-53 Jakarta 12190 - Indonesia  
 Phone : +62 21 515 0515, Fax : +62 21 515 0330, Toll Free : 0800 100 9000, Email : callcenter@idx.co.id

Sumber: www.idx.co.id

## Lampiran 06. Periode: 1 Mei 2020 – 31 Oktober 2020



**Daftar Saham untuk Penghitungan Indeks MNC36**  
**Periode Mei s.d. Oktober 2020**  
 (Lampiran Pengumuman BEI No. Peng-00128/BEI.POP/04-2020 tanggal 24 April 2020)

No.	Kode	Nama Saham	Keterangan
1	AALI	Astra Agro Lestari Tbk.	Baru
2	ADRO	Adaro Energy Tbk.	
3	AKRA	AKR Corporindo Tbk.	
4	ANTM	Aneka Tambang Tbk.	
5	ASII	Astra International Tbk.	
6	BBCA	Bank Central Asia Tbk.	
7	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	
8	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.	
9	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.	
10	BNGA	Bank CIMB Niaga Tbk.	
11	BRPT	Barito Pacific Tbk.	
12	BSDE	Bumi Serpong Damai Tbk.	
13	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.	Baru
14	CTRA	Cipta Development Tbk.	
15	DMAS	Puradelta Lestari Tbk.	
16	EXCL	XL Axiata Tbk.	
17	GGRM	Gudang Garam Tbk.	
18	HMSP	H.M. Sampoerna Tbk.	
19	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.	
20	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.	
21	ISAT	Indosat Tbk.	Baru
22	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.	Baru
23	JFFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.	Baru
24	KLBF	Kalbe Farma Tbk.	
25	MAPI	Mitra Adiperkasa Tbk.	
26	MEDC	Medco Energi Internasional Tbk.	Baru
27	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.	
28	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.	
29	PTBA	Bukit Asam Tbk.	
30	PWON	Pakuwon Jati Tbk.	
31	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.	
32	TLKM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk.	
33	TOWR	Sarana Menara Nusantara Tbk.	Baru
34	UNTR	United Tractors Tbk.	Baru
35	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.	
36	WKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.	

Sumber: [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)

## Lampiran 07. Periode: 1 November 2020 – 31 April 2021



**Daftar Saham untuk Penghitungan Indeks MNC36**  
**Periode November 2020 s.d. April 2021**  
 (Lampiran Pengumuman BEI No. Peng-00314/BEI.POP/10-2020 tanggal 21 Oktober 2020)

No.	Kode	Nama Saham	Keterangan
1	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.	Baru
2	ADRO	Adaro Energy Tbk.	
3	AKRA	AKR Corporindo Tbk.	
4	ANTM	Aneka Tambang Tbk.	
5	ASII	Astra International Tbk.	
6	BBCA	Bank Central Asia Tbk.	
7	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	
8	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk.	
9	BMRI	Bank Mandiri (Persero) Tbk.	
10	BNGA	Bank CIMB Niaga Tbk.	
11	BSDE	Bumi Serpong Damai Tbk.	
12	BTPS	Bank BTPN Syariah Tbk.	Baru
13	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.	
14	CTRA	Ciputra Development Tbk.	
15	DMAS	Puradelta Lestari Tbk.	
16	EXCL	XL Axiata Tbk.	
17	GGRM	Gudang Garam Tbk.	
18	HMSF	H.M. Sampoerna Tbk.	
19	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.	
20	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.	
21	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.	Baru
22	JFPA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.	
23	KALF	Kalbe Farma Tbk.	
24	MAPI	Mitra Adiperkasa Tbk.	
25	MDKA	Merdeka Copper Gold Tbk.	Baru
26	MEDC	Medco Energi Internasional Tbk.	
27	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.	
28	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.	
29	PTBA	Bukit Asam Tbk.	
30	PWON	Pakuwon Jati Tbk.	
31	SMRA	Summarecon Agung Tbk.	Baru
32	TLEM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk.	
33	TOWR	Sarana Menara Nusantara Tbk.	
34	ULTJ	Ultra Jaya Milk Industry & Trading Company, Tbk.	Baru
35	UNTR	United Tractors Tbk.	
36	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.	

Sumber: [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)

**Lampiran 08. Daftar penutupan harga Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan suku bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI)**

<b>Bulan</b>	<b>IHSG</b>	<b>BI-7 Days Repo Rate</b>
April 2018	Rp5.994,60	
Mei 2018	Rp5.983,59	5,25%
Juni 2018	Rp5.799,24	5,00%
Juli 2018	Rp5.936,44	4,75%
Agustus 2018	Rp6.018,46	4,75%
September 2018	Rp5.976,55	4,75%
Oktober 2018	Rp5.831,65	4,75%
November 2018	Rp6.056,12	4,75%
Desember 2018	Rp6.194,50	4,75%
Januari 2019	Rp6.532,97	4,75%
Februari 2019	Rp6.443,35	4,75%
Maret 2019	Rp6.468,75	4,75%
April 2019	Rp6.455,35	4,75%
Mei 2019	Rp6.209,12	4,50%
Juni 2019	Rp6.358,63	4,25%
Juli 2019	Rp6.390,50	4,25%
Agustus 2019	Rp6.328,47	4,25%
September 2019	Rp6.169,10	4,25%
Oktober 2019	Rp6.228,32	4,25%
November 2019	Rp6.011,83	4,25%
Desember 2019	Rp6.299,54	4,25%
Januari 2020	Rp5.940,05	4,25%
Februari 2020	Rp5.452,70	4,75%
Maret 2020	Rp4.538,93	5,25%
April 2020	Rp4.716,40	5,25%
Mei 2020	Rp4.753,61	5,50%
Juni 2020	Rp4.905,39	5,75%
Juli 2020	Rp5.149,63	5,75%
Agustus 2020	Rp5.238,49	6,00%
September 2020	Rp4.870,04	6,00%
Oktober 2020	Rp5.128,23	6,00%
November 2020	Rp5.612,42	6,00%
Desember 2020	Rp5.979,07	6,00%
Januari 2021	Rp5.862,35	6,00%
Februari 2021	Rp6.241,80	6,00%
Maret 2021	Rp5.985,52	6,00%
April 2021	Rp5.995,62	5,75%

(Sumber: data diolah ([www.yahoofinance.com](http://www.yahoofinance.com) dan [www.bi.go.id](http://www.bi.go.id)))



**Lampiran 09. (Daftar Harga penutupan masing-masing saham) (Sumber: [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id))**

Bulan	Close Price													
	ANTM	ASII	BBCA	BBNI	BBRI	BMRI	GGRM	ICBP	KLBF	MNCN	PGAS	PTBA	PWON	UNVR
April 2018	845	7.150	22.100	8.050	3.220	7.125	69.325	8.675	1.505	1.325	1.985	3.240	590	9.270
Mei 2018	865	6.900	22.700	8.475	3.080	7.050	68.500	8.700	1.370	1.200	2.070	3.800	560	9.120
Juni 2018	890	6.600	21.475	7.050	2.840	6.850	67.250	8.850	1.220	920	1.995	3.970	530	9.220
Juli 2018	915	7.150	23.275	7.400	3.070	6.650	75.150	8.725	1.295	985	1.700	4.480	515	8.650
Agustus 2018	870	7.250	24.800	7.800	3.180	6.900	73.000	8.675	1.345	905	2.140	4.050	515	8.770
September 2018	845	7.350	24.150	7.400	3.150	6.725	74.050	8.825	1.380	805	2.250	4.320	515	9.405
Oktober 2018	680	7.900	23.650	7.325	3.150	6.850	72.300	8.925	1.370	780	2.220	4.250	478	8.645
November 2018	615	8.550	26.050	8.500	3.620	7.400	82.000	9.850	1.525	790	1.955	4.020	590	8.450
Desember 2018	765	8.225	26.000	8.800	3.660	7.375	83.625	10.450	1.520	690	2.120	4.300	620	9.080
Januari 2019	965	8.450	28.175	9.075	3.850	7.450	83.650	10.775	1.600	845	2.570	4.310	650	10.000
Februari 2019	1.015	7.150	27.575	8.800	3.850	7.125	85.400	10.225	1.495	935	2.540	3.980	620	9.735
Maret 2019	885	7.325	27.750	9.400	4.120	7.450	83.200	9.325	1.520	750	2.350	4.200	690	9.845
April 2018	865	7.625	28.750	9.600	4.370	7.725	84.475	9.725	1.545	940	2.320	3.960	715	9.100
Mei 2019	725	7.450	29.100	8.400	4.100	7.675	80.475	9.800	1.405	1.140	2.060	3.060	705	8.900
Juni 2019	845	7.450	29.975	9.200	4.360	8.025	76.875	10.150	1.460	1.040	2.110	2.960	730	9.000
Juli 2019	935	7.000	30.950	8.475	4.480	7.975	75.500	10.700	1.470	1.375	2.050	2.740	735	8.720
Agustus 2019	1.070	6.675	30.500	7.700	4.270	7.250	69.475	12.050	1.690	1.240	1.920	2.470	640	9.770
September 2018	975	6.600	30.350	7.350	4.120	6.975	52.375	12.025	1.675	1.235	2.100	2.260	665	9.300
Oktober 2019	890	6.950	31.450	7.675	4.210	7.025	56.100	11.625	1.595	1.315	2.110	2.250	625	8.745
November 2019	750	6.500	31.400	7.500	4.090	6.975	50.375	11.325	1.525	1.250	1.920	2.420	565	8.360
Desember 2019	840	6.925	33.425	7.850	4.400	7.675	53.000	11.150	1.620	1.630	2.170	2.660	570	8.400
Januari 2020	720	6.350	32.400	7.200	4.460	7.550	55.775	11.375	1.430	1.590	1.705	2.210	520	7.950
Februari 2020	575	5.525	31.450	7.025	4.190	7.275	51.000	10.275	1.220	1.285	1.280	2.240	530	6.825
Maret 2020	450	3.900	27.625	3.820	3.020	4.680	41.100	10.225	1.200	905	775	2.180	308	7.250
April 2020	510	3.850	25.850	4.100	2.730	4.460	45.300	9.875	1.440	915	855	1.875	378	8.275
Mei 2020	535	4.770	25.950	3.830	2.950	4.470	48.750	8.150	1.415	850	860	1.945	362	7.750
Juni 2020	605	4.800	28.475	4.580	3.030	4.950	47.175	9.350	1.460	905	1.135	2.020	416	7.900
Juli 2020	730	5.150	31.200	4.600	3.160	5.800	49.975	9.200	1.565	820	1.265	2.030	424	8.400
Agustus 2020	820	5.100	31.375	5.100	3.510	5.950	47.500	10.225	1.580	890	1.255	2.040	408	8.225
September 2020	705	4.460	27.100	4.440	3.040	4.960	40.050	10.075	1.550	720	925	1.970	354	8.100
Oktober 2020	1.055	5.425	28.950	4.740	3.360	5.775	40.975	9.650	1.525	830	1.075	1.960	414	7.825
November 2020	1.145	5.300	31.025	6.000	4.090	6.325	42.250	9.900	1.505	1.015	1.390	2.360	500	7.725
Desember 2020	1.935	6.025	33.850	6.175	4.170	6.325	41.000	9.575	1.480	1.140	1.655	2.810	510	7.350
Januari 2021	2.220	6.100	33.800	5.550	4.180	6.575	37.725	9.100	1.465	1.035	1.345	2.580	482	6.925
Februari 2021	2.840	5.400	33.550	5.950	4.710	6.150	36.500	8.575	1.470	1.135	1.440	2.710	550	7.000
Maret 2021	2.250	5.275	31.075	5.725	4.400	6.150	36.175	9.200	1.570	955	1.315	2.620	540	6.575
April 2021	2.490	5.500	32.025	5.700	4.050	6.175	36.100	8.700	1.440	980	1.225	2.370	530	6.000

**Lampiran 10. Daftar nilai  $\alpha$ ,  $\beta$ , Residual, Excess Return to Beta (ERB), Cut-off Rate (Ci) dan Cut-off Point (C\*) masing-masing saham perusahaan**

Emiten	$\alpha$	$\beta$	Residual	ERB	Ci	C*	Keputusan
<b>ANTM</b>	0,04376	2,78445	0,05619	0,01542	0,00377	0,00377	<b>Optimal</b>
<b>ASII</b>	-0,00392	1,24253	0,01304	-0,00532	-0,00116	0,00377	-
<b>BBCA</b>	0,01094	0,90015	0,00524	0,00870	0,00232	0,00377	<b>Optimal</b>
<b>BBNI</b>	-0,00168	2,07261	0,02446	-0,00312	-0,00091	0,00377	-
<b>BBRI</b>	0,00866	1,46669	0,01284	0,00425	0,00120	0,00377	<b>Optimal</b>
<b>BMRI</b>	-0,00117	1,32189	0,01189	-0,00285	-0,00073	0,00377	-
<b>GGRM</b>	-0,01580	0,93408	0,00824	-0,02020	-0,00402	0,00377	-
<b>ICBP</b>	0,00196	0,11079	-0,00404	-0,01919	-0,00014	0,00377	-
<b>KLBF</b>	0,00054	0,59609	0,00588	-0,00495	-0,00062	0,00377	-
<b>MNCN</b>	0,00111	1,85030	0,03173	-0,00046	-0,00009	0,00377	-
<b>PGAS</b>	-0,00371	2,60116	0,04030	-0,00182	-0,00052	0,00377	-
<b>PTBA</b>	-0,00505	0,74754	0,01029	-0,01117	-0,00126	0,00377	-
<b>PWON</b>	-0,01145	0,25182	0,00390	-0,06098	-0,00224	0,00377	-
<b>UNVR</b>	-0,01048	0,25056	0,00386	-0,05744	-0,00211	0,00377	-

(Sumber: data diolah ([www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)))



**Lampiran 11. Daftar perhitungan skala pembobotan dana ( $z_i$ ), proporsi sekuritas ( $w_i$ ),  $\alpha$ ,  $\beta$ , Residual, Return Ekspektasi Pasar  $E(R_m)$  dan Varian Pasar**

$Z_i$	$W_i$	$\alpha$	$\beta$	Residual
0,57734	0,39088	0,01711	1,08840	0,02196
0,84494	0,57206	0,00626	0,51494	0,00300
0,05474	0,03706	0,00032	0,05435	0,00048
1,47702	1,00000	0,02369	1,65769	0,02544
<b>E(R<sub>m</sub>)</b>				0,00122
<b>E(R<sub>p</sub>)</b>				0,025716
<b>Var. Market</b>				0,00235
<b>Var. Por</b>				0,03189

