

## DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). Buku Manajemen Investasi dan Portofolio. Jakarta: Lembaga Penerbitan Universitas Nasional.
- Alam, R. N. Pembentukan Dan Evaluasi Kinerja Portofolio Optimal Dengan Sharia Compliant Asset Pricing Model (SCAPM) (Studi Pada Saham Jakarta Islamic Index (JII-30) Periode 2016-2022) (Master's thesis, FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UIN JAKARTA).
- Arifudin, O., Wahrudin, U., & Rusmana, F. D. (2020). Manajemen risiko. Penerbit Widina.
- Aunillah, M. W., & Wahyudi, W. (2022). Analisis Portofolio Optimal CAPM dan Single Index Model pada Perusahaan IDX30. *Jurnal Ilmiah Ekonomi Islam*, 8(2), 2231-2240.
- Dela, A. W. (2022). Analisis Tingkat Risiko Saham Berdasarkan Metode Sharia Capital Asset Pricing Model (SCAPM) (Studi Pada Perusahaan Sektor Consumer Goods Dalam Indeks JII Tahun 2018-2020) (Doctoral dissertation, UIN RADEN INTAN LAMPUNG).
- Dwi Oktavia, R., Diana Supandi, E., Istiyarti Uswatun Chasanah, S., & Studi Matematika Fakultas Sains dan Teknologi UIN Sunan Kalijaga Yogyakarta JI Marsda Adisucipto, P. (2022). Analisis Portofolio Optimal Saham Syariah Menggunakan Shari'a Compliant Asset Pricing Model (SCAPM) (Studi Kasus : Saham Syariah Jakarta Islamic Index (JII)) (Vol. 4). <https://ejournal.uin-suka.ac.id/saintek/kiiis/article/view/3214/2415>.
- Fadlan, A. (2021). Analisis Metode CAPM dan SCAPM Dalam Memprediksi Return Saham Perusahaan Di Jakarta Islamic Index (JII) (Doctoral dissertation, Universitas Hasanuddin).
- Fajri, I., Yusuf, Z., & Safitri, Y. A. (2023). Dampak Saham Syariah, Obligasi Syariah (Sukuk), Dan Reksadana Syariah Terhadap Pertumbuhan Ekonomi Di Indonesia (Studi Kasus 2011-2020). *JEMSI (Jurnal Ekonomi, Manajemen, dan Akuntansi)*, 9(6), 2423-2431.
- Fareva, I., Zulaihati, S., & Sumiati, A. (2021). The Influence Of Expectation Of Return And Perception Of Risk Towards The Interest Of Investing On Registered Student Investors In The Indonesia Stock Exchange Investment Gallery At State University Of Jakarta: Pengaruh Ekspektasi Return Dan Persepsi Risiko Terhadap Minat Investasi Investor Mahasiswa Yang Terdaftar Di Galeri Investasi Bursa Efek Indonesia Universitas Negeri Jakarta. *Indonesian Journal of Economy, Business, Entrepreneurship and Finance*, 1(2), 141-150.
- Hermuningsih, S., Kirana, K. C., & Kusumawardhani, R. (2018). Intention Determinant Of Potential Individual Investors In Decision Making Of Share Investment In Indonesia Stock Exchange. *Jurnal Akuntansi*, 6(2), 155-164.

- Kencana, D. T. (2021). Pengaruh Manajemen Laba Terhadap Return Saham Dengan Variabel Kontrol Return on Equity Pada Perusahaan Manufaktur Dalam Bursa Efek Indonesia. *TECHNOBIZ: International Journal of Business*, 4(2), 74-85.
- Khasanah, D. (2020). Optimalisasi Sharia Compliant Assets Pricing Model (SCAPM) Terhadap Return Saham Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi. <http://repository.syekhnurjati.ac.id/id/eprint/5701>
- Liniarti, S., & Nasution, R. S. A. (2022). Kajian Nilai Perusahaan pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Guepedia*.
- Liyanasari, R. (2014). Analisis perbandingan kinerja portofolio optimal pada saham syariah Indonesia dan saham syariah Malaysia periode 2009-2012 (Doctoral dissertation, Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim).
- Machfiroh, I. S. (2016). Pengukuran Risiko Portofolio Investasi Dengan Value at Risk (var) Melalui Pendekatan Metode Variansikovariansi Dan Simulasi Historis. *Jurnal Sains dan Informatika*, 2(2).
- Mastura, A., Nuringwahyu, S., & Zunaida, D. (2020). Pengaruh Motivasi Investasi, Pengetahuan Investasi Dan Teknologi Informasi Terhadap Minat Berinvestasi Di Pasar Modal (Studi Pada Mahasiswa Fia Dan Feb Unisma Yang Sudah Menempuh Mata Kuliah Mengenai Investasi). *Jiagabi*, 9(1), 64-75.
- Milati, U. (2022). Penerapan Metode Shari'a Compliant Asset Pricing (Scapm) Dalam Menetapkan Kelompok Reksa Dana Saham Syariah Efisien (Doctoral dissertation, UNUSIA).
- Misfiyati, A. L. (2019). Pengaruh Risiko Sistematis Dan Risiko Tidak Sistematis Terhadap Expected Return Portofolio Optimal (Pada Perusahaan yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index Periode 2014-2018). In *UMMagelang Conference Series* (pp. 767-784).
- Muhammad Habibullah Aminy, Laili Hurriati. (2018). *Perkembangan Obligasi Syariah (Sukuk) di Indonesia (Sukuk) di Indonesia, Jurnal Perdagangan Keuangan dan Dana, Iqtishaduna*, Vol. 9 No. 2: 136
- Mulya, S. A., Aziz, A., & Permadhy, T. (2020). Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Model Markowitz Sebagai Dasar Keputusan Investasi. In *Prosiding Biema Business Management, Economic, and Accounting National Seminar* (Vol. 1).
- Murjana, K. P. O., & Sinarwati, N. K. (2022). Persepsi Mahasiswa Tentang Flexing dan Pengaruhnya Terhadap Keputusan Investasi. *Jurnal Akuntansi Profesi*, 13(3), 837-844.
- Mustafidah, W., & Khakim, A. (2023). Analisis Perbandingan Risk dan Return Saham Syariah dan Konvensional pada Jakarta Islamic Index (JII30) dan Indeks LQ45 Periode Tahun 2020-2022. *Jurnal Ekonomi Syariah Darussalam*, 4(2), 88-100
- Oktaviani, R. F. (2017). Index harga saham Islamic internasional terhadap Jakarta Islamic index. *Jurnal Ekonomika dan Manajemen*, 6(1), 1-15.

- Quthbi, Z. H. (2017). Analisis Saham Syariah Efisien dengan Pendekatan Shari'a Compliant Asset Pricing Model (SCAPM) pada Jakarta Islamic Index (JII). *Economica: Jurnal Ekonomi Islam*, 8(1), 131-147.
- Rahmarisa, F. (2019). INVESTASI PASAR MODAL SYARIAH. In *Jurnal Ekonomi Keuangan dan Kebijakan Publik* (Vol. 1, Issue 2).
- Rahmawati, N., Sansitika, D. R., Sari, K., Oktaviani, S., & Putri, A. M. (2023). Analisis Penggunaan *Capital Asset Pricing Model* (CAPM) dalam Menentukan Keputusan Investasi pada Saham Indeks JII di Bursa Efek Indonesia. *Research in Accounting Journal (RAJ)*, 3(1), 16-24.
- Salsabila, S. D., Ardita, P. A., Yulianti, F. A., Solihah, R. A., & Abadi, M. T. (2024). Pasar Modal Syariah. *Jurnal ilmiah research and development student*, 2(1), 99-107.
- Silalahi, P. R. (2023). Teori Portofolio Dan Analisis Investasi: Integrasi Syariah.
- Suharti, E., Edawati, L., Zatira, D., & Setiawan, T. (2023). Manajemen Investasi dan Teori Portofolio.
- Tandellin, E. 2010. Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio, Edisi Pertama, Kanisius.
- Valentina, ira. (2021). Single index model dalam membentuk portofolio optimal pada saham perusahaan jakarta islamic index. Bekasi : lppm universitas bina insani

## LAMPIRAN

### Lampiran 1 Daftar Saham Syariah JII Periode Juli 2021

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.
2	ADRO	Adaro Energy Tbk.
3	AKRA	AKR Corporindo Tbk.
4	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
5	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
6	BRPT	Barito Pacific Tbk.
7	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
8	ERAA	Erajaya Swasembada Tbk.
9	EXCL	XL Axiata Tbk.
10	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
11	INCO	Vale Indonesia Tbk.
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
14	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
15	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.
16	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
17	MDKA	Merdeka Copper Gold Tbk.
18	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
19	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
20	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
21	PTBA	Bukit Asam Tbk.
22	PTPP	PP (Persero) Tbk.
23	PWON	Pakuwon Jati Tbk.
24	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
25	TKIM	Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk.
26	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
28	UNTR	United Tractors Tbk.
29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
30	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.

**Lampiran 2** Daftar Saham Syariah JII Periode September 2021

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.
2	ADRO	Adaro Energy Tbk.
3	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
4	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
5	BRPT	Barito Pacific Tbk.
6	<b>BUKA</b>	<b>Bukalapak.com Tbk.</b>
7	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
8	ERAA	Erajaya Swasembada Tbk.
9	EXCL	XL Axiata Tbk.
10	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
11	INCO	Vale Indonesia Tbk.
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
14	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
15	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.
16	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
17	MDKA	Merdeka Copper Gold Tbk.
18	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
19	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
20	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
21	PTBA	Bukit Asam Tbk.
22	PTPP	PP (Persero) Tbk.
23	PWON	Pakuwon Jati Tbk.
24	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
25	TKIM	Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk.
26	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
28	UNTR	United Tractors Tbk.
29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
30	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.

**Lampiran 3** Daftar Saham Syariah JII Periode November 2021

No.	Kode	Nama Saham
1	ADRO	Adaro Energy Tbk.
2	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
3	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
4	BRPT	Barito Pacific Tbk.
5	BUKA	Bukalapak.com Tbk.
6	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
7	<b>EMTK</b>	<b>Elang Mahkota Teknologi Tbk.</b>
8	ERAA	Erajaya Swasembada Tbk.
9	EXCL	XL Axiata Tbk.
10	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
11	INCO	Vale Indonesia Tbk.
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
14	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
15	<b>ITMG</b>	<b>Indo Tambangraya Megah Tbk.</b>
16	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.
17	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
18	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
19	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
20	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
21	PTBA	Bukit Asam Tbk.
22	PTPP	PP (Persero) Tbk.
23	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
24	<b>TINS</b>	<b>Timah Tbk.</b>
25	TKIM	Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk.
26	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
28	UNTR	United Tractors Tbk.
29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
30	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.

**Lampiran 4** Daftar Saham Syariah JII Periode Februari 2022

No.	Kode	Nama Saham
1	ADRO	Adaro Energy Tbk.
2	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
3	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
4	BRPT	Barito Pacific Tbk.
5	BUKA	Bukalapak.com Tbk.
6	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
7	EMTK	Elang Mahkota Teknologi Tbk.
8	ERAA	Erajaya Swasembada Tbk.
9	EXCL	XL Axiata Tbk.
10	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
11	INCO	Vale Indonesia Tbk.
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
14	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
15	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
16	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.
17	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
18	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
19	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
20	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
21	PTBA	Bukit Asam Tbk.
22	PTPP	PP (Persero) Tbk.
23	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
24	TINS	Timah Tbk.
25	TKIM	Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk.
26	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
28	UNTR	United Tractors Tbk.
29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
30	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.

**Lampiran 5** Daftar Saham Syariah JII Periode Juni 2022

No.	Kode	Nama Saham
1	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
2	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
3	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
4	BRPT	Barito Pacific Tbk.
5	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
6	EMTK	Elang Mahkota Teknologi Tbk.
7	ERAA	Erajaya Swasembada Tbk.
8	EXCL	XL Axiata Tbk.
9	<b>HRUM</b>	<b>Harum Energy Tbk.</b>
10	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
11	INCO	Vale Indonesia Tbk.
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
14	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
15	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
16	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.
17	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
18	<b>MDKA</b>	<b>Merdeka Copper Gold Tbk.</b>
19	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
20	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
21	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
22	PTBA	Bukit Asam Tbk.
23	<b>SCMA</b>	<b>Surya Citra Media Tbk.</b>
24	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
25	TINS	Timah Tbk.
26	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
28	UNTR	United Tractors Tbk.
29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
30	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.



**Lampiran 6** Daftar Saham Syariah JII Periode Agustus 2022

No.	Kode	Nama Saham
1	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
2	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
3	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
4	BRPT	Barito Pacific Tbk.
5	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
6	EMTK	Elang Mahkota Teknologi Tbk.
7	ERAA	Erajaya Swasembada Tbk.
8	EXCL	XL Axiata Tbk.
9	HRUM	Harum Energy Tbk.
10	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
11	INCO	Vale Indonesia Tbk.
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
14	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
15	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
16	JPFA	Japfa Comfeed Indonesia Tbk.
17	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
18	MDKA	Merdeka Copper Gold Tbk.
19	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
20	MNCN	Media Nusantara Citra Tbk.
21	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
22	PTBA	Bukit Asam Tbk.
23	SCMA	Surya Citra Media Tbk.
24	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
25	TINS	Timah Tbk.
26	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
28	UNTR	United Tractors Tbk.
29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
30	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.

**Lampiran 7** Daftar Saham Syariah JII Periode November 2022

No.	Kode	Nama Saham
1	<b>ACES</b>	<b>Ace Hardware Indonesia Tbk.</b>
2	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
3	<b>AKRA</b>	<b>AKR Corporindo Tbk.</b>
4	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
5	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
6	<b>BRMS</b>	<b>Bumi Resources Minerals Tbk.</b>
7	BRPT	Barito Pacific Tbk.
8	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
9	EXCL	XL Axiata Tbk.
10	<b>HEAL</b>	<b>Medikaloka Hermina Tbk.</b>
11	HRUM	Harum Energy Tbk.
12	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
13	INCO	Vale Indonesia Tbk.
14	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
15	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
16	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
17	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
18	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
19	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
20	<b>MTEL</b>	<b>Dayamitra Telekomunikasi Tbk.</b>
21	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
22	PTBA	Bukit Asam Tbk.
23	SCMA	Surya Citra Media Tbk.
24	<b>SIDO</b>	<b>Industri Jamu dan Farmasi Sido Muncul Tbk.</b>
25	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
26	TINS	Timah Tbk.
27	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
28	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
29	UNTR	United Tractors Tbk.
30	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.

**Lampiran 8** Daftar Saham Syariah JII Periode Mei 2023

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	<b>Ace Hardware Indonesia Tbk.</b>
2	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
3	AKRA	<b>AKR Corporindo Tbk.</b>
4	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
5	<b>ASII</b>	PT Astra International Tbk.
6	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
7	BRMS	Bumi Resources Minerals Tbk.
8	BRPT	Barito Pacific Tbk.
9	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.
10	<b>ESSA</b>	<b>PT ESSA Industries Indonesia Tbk.</b>
11	EXCL	XL Axiata Tbk.
12	HRUM	Harum Energy Tbk.
13	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
14	INCO	Vale Indonesia Tbk.
15	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
16	<b>INDY</b>	PT. Indika Energy Tbk
17	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
18	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
19	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
20	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
21	<b>MDKA</b>	<b>PT Merdeka Copper Gold Tbk.</b>
22	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
23	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
24	PTBA	Bukit Asam Tbk.
25	SCMA	Surya Citra Media Tbk.
26	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
27	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
28	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
29	UNTR	United Tractors Tbk.
30	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.

**Lampiran 9** Daftar Saham Syariah JII Periode Agustus 2023

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	<b>Ace Hardware Indonesia Tbk.</b>
2	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
3	AKRA	<b>AKR Corporindo Tbk.</b>
4	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
5	ASII	PT Astra International Tbk
6	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
7	BRMS	<b>Bumi Resources Minerals Tbk.</b>
8	BRPT	Barito Pacific Tbk.
9	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk
10	ESSA	<b>PT ESSA Industries Indonesia Tbk.</b>
11	EXCL	XL Axiata Tbk.
12	HRUM	Harum Energy Tbk.
13	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
14	INCO	Vale Indonesia Tbk.
15	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
16	INDY	PT. Indika Energy Tbk.
17	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
18	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
19	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
20	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
21	MDKA	<b>PT Merdeka Copper Gold Tbk.</b>
22	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
23	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
24	PTBA	Bukit Asam Tbk.
25	SCMA	Surya Citra Media Tbk.
26	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
27	TLKM	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
28	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
29	UNTR	United Tractors Tbk.
30	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.

**Lampiran 10** Daftar Saham Syariah JII Periode November 2023

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.
2	<b>ADMR</b>	<b>PT Adaro Minerals Indonesia Tbk</b>
3	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
4	AKRA	AKR Corporindo Tbk.
5	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
6	ASII	PT Astra International Tbk.
7	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
8	BRMS	Bumi Resources Minerals Tbk.
9	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.
10	<b>EMTK</b>	<b>PT Elang Mahkota Teknologi Tbk.</b>
11	EXCL	XL Axiata Tbk.
12	<b>GOTO</b>	<b>PT GoTo Gojek Tokopedia Tbk.</b>
13	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
14	INCO	Vale Indonesia Tbk.
15	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
16	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
17	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
18	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
19	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
20	<b>MAPI</b>	<b>PT Mitra Adiperkasa Tbk.</b>
21	MDKA	PT Merdeka Copper Gold Tbk.
22	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
23	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
24	PTBA	Bukit Asam Tbk.
25	SMGR	Surya Citra Media Tbk.
26	TLKM	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
28	UNTR	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
29	UNVR	United Tractors Tbk.
30	<b>WIFI</b>	<b>PT Solusi Sinergi Digital Tbk.</b>

**Lampiran 11** Daftar Saham Syariah JII Periode Februari 2024

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.
2	ADMR	PT Adaro Minerals Indonesia Tbk.
3	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
4	AKRA	AKR Corporindo Tbk.
5	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
6	ASII	PT Astra International Tbk
7	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
8	BRMS	Bumi Resources Minerals Tbk.
9	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.
10	EMTK	PT Elang Mahkota Teknologi Tbk.
11	EXCL	XL Axiata Tbk.
12	GOTO	PT GoTo Gojek Tokopedia Tbk.
13	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
14	INCO	Vale Indonesia Tbk.
15	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
16	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
17	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk.
18	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
19	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
20	MAPI	PT Mitra Adiperkasa Tbk.
21	MDKA	PT Merdeka Copper Gold Tbk.
22	MIKA	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk.
23	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
24	PTBA	Bukit Asam Tbk.
25	SMGR	Surya Citra Media Tbk.
26	TLKM	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
27	TPIA	Telkom Indonesia (Persero) Tbk.
28	UNTR	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
29	UNVR	United Tractors Tbk.
30	WIFI	PT Solusi Sinergi Digital Tbk.

**Lampiran 12** Daftar Saham Syariah JII Periode Mei 2024

No.	Kode	Nama Saham
1	ACES	Ace Hardware Indonesia Tbk.
2	ADMR	PT Adaro Minerals Indonesia Tbk.
3	ADRO	Adaro Energy Indonesia Tbk.
4	AKRA	AKR Corporindo Tbk.
5	<b>AMMN</b>	<b>PT Amman Mineral Internasional Tbk.</b>
6	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
7	ASII	PT Astra International Tbk
8	BRIS	Bank Syariah Indonesia Tbk.
9	BRMS	Bumi Resources Minerals Tbk.
10	<b>BRPT</b>	<b>PT Barito Pacific Tbk.</b>
11	CPIN	Charoen Pokphand Indonesia Tbk.
12	EXCL	XL Axiata Tbk.
13	GOTO	PT GoTo Gojek Tokopedia Tbk.
14	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
15	INCO	Vale Indonesia Tbk.
16	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
17	INKP	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk.
18	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
19	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
20	MAPI	PT Mitra Adiperkasa Tbk.
21	<b>MBMA</b>	<b>PT Merdeka Battery Materials Tbk.</b>
22	MDKA	PT Merdeka Copper Gold Tbk.
23	<b>MEDC</b>	<b>PT Medco Energi Internasional Tbk.</b>
24	PGAS	Perusahaan Gas Negara Tbk.
25	<b>PGEO</b>	<b>PT Pertamina Geothermal Energy Tbk.</b>
26	PTBA	Bukit Asam Tbk.
27	SMGR	Surya Citra Media Tbk.
28	TLKM	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
29	UNTR	United Tractors Tbk.
30	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.

**Lampiran 13** Harga Pasar dan Nilai *return* Pasar

Date	XIJI	Ri
01/08/2021	554	
01/09/2021	568	0,02527076
01/10/2021	591	0,04049296
01/11/2021	595	0,00676819
01/12/2021	598	0,00504202
01/01/2022	600	0,00334448
01/02/2022	616	0,02666667
01/03/2022	639	0,03733766
01/04/2022	666	0,04225352
01/05/2022	670	0,00600601
01/06/2022	639	-0,04626866
01/07/2022	655	0,02503912
01/08/2022	670	0,02290076
01/09/2022	669	-0,00149254
01/10/2022	688	0,0284006
01/11/2022	677	-0,01598837
01/12/2022	655	-0,03249631
01/01/2023	644	-0,01679389
01/02/2023	640	-0,00621118
01/03/2023	630	-0,015625
01/04/2023	639	0,01428571
01/05/2023	612	-0,04225352
01/06/2023	615	0,00490196
01/07/2023	621	0,0097561
01/08/2023	630	0,01449275
01/09/2023	633	0,0047619
01/10/2023	600	-0,0521327
01/11/2023	590	-0,01666667
01/12/2023	606	0,02711864
01/01/2024	601	-0,00825083
01/02/2024	585	-0,0266223
01/03/2024	590	0,00854701
01/04/2024	588	-0,00338983
01/05/2024	597	0,01530612
01/06/2024	592	-0,00837521



01/07/2024	609	0,02871622
31/07/2024	602	-0,01149425

**Lampiran 14** Harga Saham ADRO, ANTM, BRIS, CPIN, dan EXCL

Date	ADRO	ANTM	BRIS	CPIN	EXCL
01/08/2021	1260	2390	2165,186	6400	2670
01/09/2021	1760	2290	1989,63	6425	3040
01/10/2021	1680	2340	2057,902	6200	3080
01/11/2021	1700	2300	1906,729	6075	3070
01/12/2021	2250	2250	1736,05	5950	3170
01/01/2022	2240	1770	1506,852	6300	3320
01/02/2022	2450	2220	1623,889	5800	2860
01/03/2022	2690	2440	1565,371	5650	2650
01/04/2022	3340	2600	1540,988	5150	3190
01/05/2022	3270	2510	1404,445	5400	2640
01/06/2022	2860	1800	1306,914	6000	2600
01/07/2022	3250	1955	1594,63	5600	2370
01/08/2022	3540	1990	1482,469	5875	2630
01/09/2022	3960	1940	1433,704	5650	2460
01/10/2022	3980	1845	1365,432	5575	2520
01/11/2022	3870	1985	1302,037	5700	2170
01/12/2022	3850	1985	1290	5650	2140
01/01/2023	2960	2310	1335	5825	2300
01/02/2023	2990	1990	1520	5375	2090
01/03/2023	2900	2090	1680	4990	1980
01/04/2023	3130	2100	1730	4590	1750
01/05/2023	2040	1895	1730	4950	1985
01/06/2023	2230	1950	1690	5275	1955
01/07/2023	2410	1985	1655	5175	2270
01/08/2023	2670	1990	1710	5175	2500
01/09/2023	2850	1815	1625	5425	2380
01/10/2023	2560	1705	1500	5800	2270
01/11/2023	2620	1740	1655	5200	2120
01/12/2023	2380	1705	1740	5025	2000
01/01/2024	2400	1550	2330	4480	2320
01/02/2024	2420	1460	2470	4840	2380

01/03/2024	2700	1600	2710	5250	2260
01/04/2024	2710	1640	2640	4950	2470
01/05/2024	2770	1465	2200	5200	2310
01/06/2024	2790	1250	2620	5075	2160
01/07/2024	3230	1300	2480	5200	2170
31/07/2024	3220	1315	2600	5225	2170

**Lampiran 15** Harga Saham ICBP, INCO, INDF, INKP, dan KLBF

Date	ICBP	INCO	INDF	INKP	KLBF
01/08/2021	8425	5075	6175	7900	1345
01/09/2021	8350	4590	6350	8575	1430
01/10/2021	8800	4850	6350	8475	1600
01/11/2021	8450	4790	6300	7550	1600
01/12/2021	8700	4680	6325	7825	1615
01/01/2022	8725	4710	6325	7600	1640
01/02/2022	8500	5400	6200	8075	1645
01/03/2022	7350	6700	5950	7900	1610
01/04/2022	7625	7300	6300	7575	1640
01/05/2022	8575	8225	6600	8250	1675
01/06/2022	9550	5650	7050	7600	1660
01/07/2022	8825	6100	6800	7600	1620
01/08/2022	8300	6100	6225	8325	1680
01/09/2022	8650	6400	6025	9050	1830
01/10/2022	9725	6500	6450	9600	2050
01/11/2022	10100	7375	6450	10000	2070
01/12/2022	10000	7100	6725	8725	2090
01/01/2023	10100	7425	6725	8325	2060
01/02/2023	10125	6825	6475	7925	2110
01/03/2023	9975	6650	6200	7500	2100
01/04/2023	10575	6975	6450	7775	2120
01/05/2023	11700	6300	7100	6900	2030
01/06/2023	11325	6300	7350	8500	2050
01/07/2023	11200	6875	7325	9150	1915
01/08/2023	11200	5900	7100	9100	1815
01/09/2023	11075	5650	6625	11100	1755
01/10/2023	10350	4950	6650	9600	1690

01/11/2023	11550	4500	6425	8775	1615
01/12/2023	10575	4310	6450	8325	1610
01/01/2024	11775	3870	6375	7825	1510
01/02/2024	11550	4050	6625	8725	1490
01/03/2024	11600	4070	6375	9575	1475
01/04/2024	10875	4250	6250	9375	1455
01/05/2024	9750	4970	5875	9100	1490
01/06/2024	10300	4220	6075	8900	1525
01/07/2024	10900	3680	6050	8225	1565
31/07/2024	10925	3740	6125	8350	1590

**Lampiran 16** Harga Saham PGAS, PTBA, SMGR, TLKM, UNTR, dan UNVR

Date	PGAS	PTBA	SMGR	TLKM	UNTR	UNVR
01/08/2021	1035	2110	9224,336	3400	20075	4050
01/09/2021	1190	2760	8177,249	3690	26000	3950
01/10/2021	1510	2680	9074,752	3800	23550	4420
01/11/2021	1500	2600	7977,804	3990	21350	4480
01/12/2021	1375	2710	7229,885	4040	22150	4110
01/01/2022	1380	2850	6706,341	4190	23125	4030
01/02/2022	1440	3140	7180,023	4340	24900	3680
01/03/2022	1405	3290	6631,55	4580	25550	3660
01/04/2022	1450	3820	6382,243	4620	30275	3890
01/05/2022	1800	4530	7279,746	4310	31300	4730
01/06/2022	1590	3820	7105,232	4000	28400	4770
01/07/2022	1680	4300	6506,896	4230	32300	4510
01/08/2022	1840	4250	6581,688	4560	33850	4590
01/09/2022	1755	4170	7454,261	4460	32825	4830
01/10/2022	1975	3910	7927,943	4390	32300	4640
01/11/2022	1880	3800	7578,914	4040	30800	4800
01/12/2022	1760	3690	6575	3750	26075	4700
01/01/2023	1545	3400	7400	3850	24550	4660
01/02/2023	1565	3860	7225	3880	27900	4180
01/03/2023	1380	3990	6300	4060	29100	4350
01/04/2023	1430	4140	5950	4250	28900	4400
01/05/2023	1430	3060	5800	4040	22225	4530
01/06/2023	1305	2680	6075	4000	23275	4260

01/07/2023	1365	2770	6975	3720	27525	3850
01/08/2023	1375	2860	6800	3730	26000	3670
01/09/2023	1375	2800	6425	3750	28250	3740
01/10/2023	1255	2480	6100	3490	25125	3620
01/11/2023	1115	2420	6500	3760	21900	3650
01/12/2023	1130	2440	6400	3950	22625	3530
01/01/2024	1165	2610	6200	3960	22950	3100
01/02/2024	1090	2560	6100	4000	23525	2730
01/03/2024	1360	2970	5900	3470	24175	2700
01/04/2024	1470	3030	4670	3170	24825	2620
01/05/2024	1580	2490	3490	2900	22075	3120
01/06/2024	1540	2450	3730	3130	21975	3020
01/07/2024	1605	2640	3900	2880	25000	2430
31/07/2024	1600	2680	3910	2880	25800	2440

**Lampiran 17 Nilai Return ADRO, ANTM, BRIS, CPIN, dan EXCL**

Date	ADRO	ANTM	BRIS	CPIN	EXCL
01/08/2021					
01/09/2021	0,3968	-0,0418	-0,0811	0,0039	0,1386
01/10/2021	-0,0455	0,0218	0,0343	-0,0350	0,0132
01/11/2021	0,0119	-0,0171	-0,0735	-0,0202	-0,0032
01/12/2021	0,3235	-0,0217	-0,0895	-0,0206	0,0326
01/01/2022	-0,0044	-0,2133	-0,1320	0,0588	0,0473
01/02/2022	0,0938	0,2542	0,0777	-0,0794	-0,1386
01/03/2022	0,0980	0,0991	-0,0360	-0,0259	-0,0734
01/04/2022	0,2416	0,0656	-0,0156	-0,0885	0,2038
01/05/2022	-0,0210	-0,0346	-0,0886	0,0485	-0,1724
01/06/2022	-0,1254	-0,2829	-0,0694	0,1111	-0,0152
01/07/2022	0,1364	0,0861	0,2201	-0,0667	-0,0885
01/08/2022	0,0892	0,0179	-0,0703	0,0491	0,1097
01/09/2022	0,1186	-0,0251	-0,0329	-0,0383	-0,0646
01/10/2022	0,0051	-0,0490	-0,0476	-0,0133	0,0244
01/11/2022	-0,0276	0,0759	-0,0464	0,0224	-0,1389
01/12/2022	-0,0052	0,0000	-0,0092	-0,0088	-0,0138

01/01/2023	-0,2312	0,1637	0,0349	0,0310	0,0748
01/02/2023	0,0101	-0,1385	0,1386	-0,0773	-0,0913
01/03/2023	-0,0301	0,0503	0,1053	-0,0716	-0,0526
01/04/2023	0,0793	0,0048	0,0298	-0,0802	-0,1162
01/05/2023	-0,3482	-0,0976	0,0000	0,0784	0,1343
01/06/2023	0,0931	0,0290	-0,0231	0,0657	-0,0151
01/07/2023	0,0807	0,0179	-0,0207	-0,0190	0,1611
01/08/2023	0,1079	0,0025	0,0332	0,0000	0,1013
01/09/2023	0,0674	-0,0879	-0,0497	0,0483	-0,0480
01/10/2023	-0,1018	-0,0606	-0,0769	0,0691	-0,0462
01/11/2023	0,0234	0,0205	0,1033	-0,1034	-0,0661
01/12/2023	-0,0916	-0,0201	0,0514	-0,0337	-0,0566
01/01/2024	0,0084	-0,0909	0,3391	-0,1085	0,1600
01/02/2024	0,0083	-0,0581	0,0601	0,0804	0,0259
01/03/2024	0,1157	0,0959	0,0972	0,0847	-0,0504
01/04/2024	0,0037	0,0250	-0,0258	-0,0571	0,0929
01/05/2024	0,0221	-0,1067	-0,1667	0,0505	-0,0648
01/06/2024	0,0072	-0,1468	0,1909	-0,0240	-0,0649
01/07/2024	0,1577	0,0400	-0,0534	0,0246	0,0046
31/07/2024	-0,0031	0,0115	0,0484	0,0048	0,0000
Rata-Rata	0,0351	-0,0114	0,0099	-0,0039	-0,0016

**Lampiran 18** Nilai Return ICBP, INCO, INDF, INKP, dan KLBF

Date	ICBP	INCO	INDF	INKP	KLBF
01/08/2021					
01/09/2021	-0,0089	-0,0956	0,0283	0,0854	0,0632
01/10/2021	0,0539	0,0566	0,0000	-0,0117	0,1189
01/11/2021	-0,0398	-0,0124	-0,0079	-0,1091	0,0000
01/12/2021	0,0296	-0,0230	0,0040	0,0364	0,0094
01/01/2022	0,0029	0,0064	0,0000	-0,0288	0,0155
01/02/2022	-0,0258	0,1465	-0,0198	0,0625	0,0030
01/03/2022	-0,1353	0,2407	-0,0403	-0,0217	-0,0213
01/04/2022	0,0374	0,0896	0,0588	-0,0411	0,0186
01/05/2022	0,1246	0,1267	0,0476	0,0891	0,0213
01/06/2022	0,1137	-0,3131	0,0682	-0,0788	-0,0090
01/07/2022	-0,0759	0,0796	-0,0355	0,0000	-0,0241

01/08/2022	-0,0595	0,0000	-0,0846	0,0954	0,0370
01/09/2022	0,0422	0,0492	-0,0321	0,0871	0,0893
01/10/2022	0,1243	0,0156	0,0705	0,0608	0,1202
01/11/2022	0,0386	0,1346	0,0000	0,0417	0,0098
01/12/2022	-0,0099	-0,0373	0,0426	-0,1275	0,0097
01/01/2023	0,0100	0,0458	0,0000	-0,0458	-0,0144
01/02/2023	0,0025	-0,0808	-0,0372	-0,0480	0,0243
01/03/2023	-0,0148	-0,0256	-0,0425	-0,0536	-0,0047
01/04/2023	0,0602	0,0489	0,0403	0,0367	0,0095
01/05/2023	0,1064	-0,0968	0,1008	-0,1125	-0,0425
01/06/2023	-0,0321	0,0000	0,0352	0,2319	0,0099
01/07/2023	-0,0110	0,0913	-0,0034	0,0765	-0,0659
01/08/2023	0,0000	-0,1418	-0,0307	-0,0055	-0,0522
01/09/2023	-0,0112	-0,0424	-0,0669	0,2198	-0,0331
01/10/2023	-0,0655	-0,1239	0,0038	-0,1351	-0,0370
01/11/2023	0,1159	-0,0909	-0,0338	-0,0859	-0,0444
01/12/2023	-0,0844	-0,0422	0,0039	-0,0513	-0,0031
01/01/2024	0,1135	-0,1021	-0,0116	-0,0601	-0,0621
01/02/2024	-0,0191	0,0465	0,0392	0,1150	-0,0132
01/03/2024	0,0043	0,0049	-0,0377	0,0974	-0,0101
01/04/2024	-0,0625	0,0442	-0,0196	-0,0209	-0,0136
01/05/2024	-0,1034	0,1694	-0,0600	-0,0293	0,0241
01/06/2024	0,0564	-0,1509	0,0340	-0,0220	0,0235
01/07/2024	0,0583	-0,1280	-0,0041	-0,0758	0,0262
31/07/2024	0,0023	0,0163	0,0124	0,0152	0,0160
Rata-Rata	0,0094	-0,0026	0,0006	0,0052	0,0055

**Lampiran 19** Nilai Return PGAS, PTBA, SMGR, TLKM, UNTR, dan UNVR

Date	PGAS	PTBA	SMGR	TLKM	UNTR	UNVR
01/08/2021						
01/09/2021	0,1498	0,3081	-0,1135	0,0853	0,2951	-0,0247
01/10/2021	0,2689	-0,0290	0,1098	0,0298	-0,0942	0,1190
01/11/2021	-0,0066	-0,0299	-0,1209	0,0500	-0,0934	0,0136
01/12/2021	-0,0833	0,0423	-0,0938	0,0125	0,0375	-0,0826
01/01/2022	0,0036	0,0517	-0,0724	0,0371	0,0440	-0,0195
01/02/2022	0,0435	0,1018	0,0706	0,0358	0,0768	-0,0868

01/03/2022	-0,0243	0,0478	-0,0764	0,0553	0,0261	-0,0054
01/04/2022	0,0320	0,1611	-0,0376	0,0087	0,1849	0,0628
01/05/2022	0,2414	0,1859	0,1406	-0,0671	0,0339	0,2159
01/06/2022	-0,1167	-0,1567	-0,0240	-0,0719	-0,0927	0,0085
01/07/2022	0,0566	0,1257	-0,0842	0,0575	0,1373	-0,0545
01/08/2022	0,0952	-0,0116	0,0115	0,0780	0,0480	0,0177
01/09/2022	-0,0462	-0,0188	0,1326	-0,0219	-0,0303	0,0523
01/10/2022	0,1254	-0,0624	0,0635	-0,0157	-0,0160	-0,0393
01/11/2022	-0,0481	-0,0281	-0,0440	-0,0797	-0,0464	0,0345
01/12/2022	-0,0638	-0,0289	-0,1325	-0,0718	-0,1534	-0,0208
01/01/2023	-0,1222	-0,0786	0,1255	0,0267	-0,0585	-0,0085
01/02/2023	0,0129	0,1353	-0,0236	0,0078	0,1365	-0,1030
01/03/2023	-0,1182	0,0337	-0,1280	0,0464	0,0430	0,0407
01/04/2023	0,0362	0,0376	-0,0556	0,0468	-0,0069	0,0115
01/05/2023	0,0000	-0,2609	-0,0252	-0,0494	-0,2310	0,0295
01/06/2023	-0,0874	-0,1242	0,0474	-0,0099	0,0472	-0,0596
01/07/2023	0,0460	0,0336	0,1481	-0,0700	0,1826	-0,0962
01/08/2023	0,0073	0,0325	-0,0251	0,0027	-0,0554	-0,0468
01/09/2023	0,0000	-0,0210	-0,0551	0,0054	0,0865	0,0191
01/10/2023	-0,0873	-0,1143	-0,0506	-0,0693	-0,1106	-0,0321
01/11/2023	-0,1116	-0,0242	0,0656	0,0774	-0,1284	0,0083
01/12/2023	0,0135	0,0083	-0,0154	0,0505	0,0331	-0,0329
01/01/2024	0,0310	0,0697	-0,0313	0,0025	0,0144	-0,1218
01/02/2024	-0,0644	-0,0192	-0,0161	0,0101	0,0251	-0,1194
01/03/2024	0,2477	0,1602	-0,0328	-0,1325	0,0276	-0,0110
01/04/2024	0,0809	0,0202	-0,2085	-0,0865	0,0269	-0,0296
01/05/2024	0,0748	-0,1782	-0,2527	-0,0852	-0,1108	0,1908
01/06/2024	-0,0253	-0,0161	0,0688	0,0793	-0,0045	-0,0321
01/07/2024	0,0422	0,0776	0,0456	-0,0799	0,1377	-0,1954
31/07/2024	-0,0031	0,0152	0,0026	0,0000	0,0320	0,0041
Rata-Rata	0,0167	0,0124	-0,0191	-0,0029	0,0123	-0,0109

**Lampiran 20** Nilai Alpha dan Beta Masing-Masing Saham

Nama Saham	$\beta$	$\alpha$
ADRO	3,259755	0,02669
ANTM	1,65461	-0,01571

BRIS	-0,265	0,010562
CPIN	-0,89599	-0,00156
EXCL	0,223662	-0,00215
ICBP	-0,64763	0,01106
INCO	2,135164	-0,00814
INDF	-0,47266	0,001838
INKP	1,18471	0,0021
KLBF	0,712518	0,003675
PGAS	2,390473	0,010481
PTBA	2,31097	0,006391
SMGR	0,318064	-0,01991
TLKM	0,794754	-0,00498
UNTR	2,384794	0,006141
UNVR	0,170565	-0,01138

**Lampiran 21** Variansi residual error, Risiko Pasar, Risiko Masing-Masing Saham

Nama Saham	$\sigma^2_i$	$\sigma_{im}$	$\sigma^2_{ei}$
ADRO	0,017387082	0,00183068	0,02335465
ANTM	0,009663761	0,000929229	0,011201272
BRIS	0,010239	-0,000148821	0,010278437
CPIN	0,003451108	-0,000503186	0,003901956
EXCL	0,008481962	0,000125609	0,008510056
ICBP	0,004306927	-0,000363711	0,004542478
INCO	0,011172025	0,001199109	0,013732319
INDF	0,001686589	-0,000265445	0,001812053
INKP	0,007520539	0,000665334	0,008308766
KLBF	0,001777035	0,00040015	0,001297835
PGAS	0,009585588	0,001342491	0,012794777
PTBA	0,01142905	0,001297842	0,014428324
SMGR	0,01142905	0,000178625	0,011485865
TLKM	0,003294758	0,000446334	0,003649484
UNTR	0,010803559	0,001339301	0,013997517



UNVR	0,00616275	9,57896E-05	0,006179088
------	------------	-------------	-------------