

Lampiran 1 Perhitungan VaR AKRA 2 Tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	Time Horizon 30 Hari Kedepan
01/12/2011	3025	13643100	41.270.377.500	0,059592097	-0,183478295	-0,145711811	Rp (6.013.581.446)	-Rp32.937.742.095
01/11/2011	2850	15134100	43.132.185.000	-0,059592097	-0,145711811	-0,145711811	Rp (6.284.868.789)	
03/10/2011	3025	13583100	41.088.877.500	0,231442354	-0,140581951	-0,145711811	Rp (5.987.134.752)	
05/09/2011	2400	17127800	41.106.720.000	-0,099090903	-0,099090903	-0,145711811	Rp (5.989.734.615)	
01/08/2011	2650	24556500	65.074.725.000	-0,140581951	-0,09237332	-0,145711811	Rp (9.482.156.030)	
01/07/2011	3050	18149600	55.356.280.000	0,361369788	-0,06001801	-0,145711811	Rp (8.066.063.809)	
01/06/2011	2125	13051800	27.735.075.000	0,144006231	-0,059592097	-0,145711811	Rp (4.041.328.006)	
02/05/2011	1840	17635600	32.449.504.000	0,073272201	-0,05942342	-0,145711811	Rp (4.728.275.994)	
01/04/2011	1710	20589500	35.208.045.000	0,15123097	-0,033673215	-0,145711811	Rp (5.130.227.999)	
01/03/2011	1470	15409200	22.651.524.000	-0,05942342	0	-0,145711811	Rp (3.300.594.584)	
01/02/2011	1560	12969900	20.233.044.000	0,080042708	0	-0,145711811	Rp (2.948.193.483)	
03/01/2011	1440	18473900	26.602.416.000	-0,183478295	0,033060862	-0,145711811	Rp (3.876.286.212)	
01/12/2010	1730	15969000	27.626.370.000	0,169684973	0,059592097	-0,145711811	Rp (4.025.488.404)	
01/11/2010	1460	19572900	28.576.434.000	-0,033673215	0,073272201	-0,145711811	Rp (4.163.923.950)	
01/10/2010	1510	25709600	38.821.496.000	0	0,080042708	-0,145711811	Rp (5.656.750.488)	
01/09/2010	1510	21089900	31.845.749.000	0,205095481	0,088728116	-0,145711811	Rp (4.640.301.759)	
02/08/2010	1230	12813300	15.760.359.000	0,033060862	0,102129495	-0,145711811	Rp (2.296.470.452)	
01/07/2010	1190	15092300	17.959.837.000	0,115684399	0,115684399	-0,145711811	Rp (2.616.960.375)	
01/06/2010	1060	13742900	14.567.474.000	0,088728116	0,144006231	-0,145711811	Rp (2.122.653.018)	
03/05/2010	970	15967800	15.488.766.000	-0,06001801	0,15123097	-0,145711811	Rp (2.256.896.144)	
01/04/2010	1030	22462300	23.136.169.000	0,102129495	0,169684973	-0,145711811	Rp (3.371.213.085)	
01/03/2010	930	18355200	17.070.336.000	-0,09237332	0,205095481	-0,145711811	Rp (2.487.349.573)	
01/02/2010	1020	16867000	17.204.340.000	-0,145711811	0,231442354	-0,145711811	Rp (2.506.875.538)	
07/01/2010	1180	17771300	20.970.134.000	0	0,361369788	-0,145711811	Rp (3.055.596.202)	

Lampiran 2 Perhitungan VaR BORN 2 Tahun

Date	Close	Volume	Exposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	Time Horizon 30 Hari Kedepan
01/12/2011	830	21672000	17.987.760.000	0,024391453	-0,264953821	-0,264953821	Rp (4.765.925.743)	-Rp26.104.050.370
01/11/2011	810	137222600	111.150.306.000	-0,240279834	-0,240279834	-0,264953821	Rp (29.449.698.280)	
03/10/2011	1030	71600100	73.748.103.000	0,146092618	-0,188052232	-0,264953821	Rp (19.539.841.681)	
05/09/2011	890	53108400	47.266.476.000	-0,264953821	-0,117783036	-0,264953821	Rp (12.523.433.421)	
01/08/2011	1160	55240600	64.079.096.000	-0,188052232	-0,082238098	-0,264953821	Rp (16.978.001.331)	
01/07/2011	1400	46791700	65.508.380.000	0	-0,019802627	-0,264953821	Rp (17.356.695.589)	
01/06/2011	1400	34978300	48.969.620.000	-0,082238098	0	-0,264953821	Rp (12.974.687.932)	
02/05/2011	1520	44457900	67.576.008.000	-0,117783036	0	-0,264953821	Rp (17.904.521.528)	
01/04/2011	1710	29289200	50.084.532.000	0,035718083	0,024391453	-0,264953821	Rp (13.270.088.126)	
01/03/2011	1650	50749500	83.736.675.000	0,09531018	0,035718083	-0,264953821	Rp (22.186.351.999)	
01/02/2011	1500	34878100	52.317.150.000	-0,019802627	0,09531018	-0,264953821	Rp (13.861.628.796)	
03/01/2011	1530	89754600	137.324.538.000	0,132598121	0,132598121	-0,264953821	Rp (36.384.661.060)	
01/12/2010	1340	61434800	82.322.632.000	0,135665865	0,135665865	-0,264953821	Rp (21.811.695.903)	
26/11/2010	1170	616105500	720.843.435.000	0	0,146092618	-0,264953821	Rp(190.990.222.446)	

Lampiran 3 Perhitungan VaR HRUM 2 Tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Pecentile	Prediksi VaR	<i>Time Horizon 30 Hari Kedepan</i>
01/12/2011	6850	6671600	45.700.460.000	0,022141126	-0,224433042	-0,224433042	Rp (10.256.693.259)	-Rp56.178.222.631
01/11/2011	6700	8452300	56.630.410.000	-0,158406005	-0,158406005	-0,224433042	Rp (12.709.735.186)	
03/10/2011	7850	10334300	81.124.255.000	0,100418748	-0,124052649	-0,224433042	Rp (18.206.963.330)	
05/09/2011	7100	9923700	70.458.270.000	-0,087598059	-0,087598059	-0,224433042	Rp (15.813.163.870)	
01/08/2011	7750	11094700	85.983.925.000	-0,224433042	-0,048009219	-0,224433042	Rp (19.297.633.851)	
01/07/2011	9700	4712500	45.711.250.000	0,015584731	0	-0,224433042	Rp (10.259.114.891)	
01/06/2011	9550	6129600	58.537.680.000	0,042787275	0,015584731	-0,224433042	Rp (13.137.789.594)	
02/05/2011	9150	4643400	42.487.110.000	-0,048009219	0,022141126	-0,224433042	Rp (9.535.511.343)	
01/04/2011	9600	4645900	44.600.640.000	0,070109566	0,037041272	-0,224433042	Rp (10.009.857.310)	
01/03/2011	8950	5230100	46.809.395.000	0,081440332	0,042787275	-0,224433042	Rp (10.505.574.914)	
01/02/2011	8250	4549000	37.529.250.000	0,037041272	0,070109566	-0,224433042	Rp (8.422.803.741)	
03/01/2011	7950	7823600	62.197.620.000	-0,124052649	0,081440332	-0,224433042	Rp (13.959.201.062)	
01/12/2010	9000	7221100	64.989.900.000	0,280301965	0,100418748	-0,224433042	Rp (14.585.880.956)	
01/11/2010	6800	11977900	81.449.720.000	0,150480951	0,150480951	-0,224433042	Rp (18.280.008.430)	
06/10/2010	5850	15633300	91.454.805.000	0	0,280301965	-0,224433042	Rp (20.525.480.092)	

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	<i>Time Horizon 30 Hari Kedepan</i>
01/12/2011	5200	741700	3.856.840.000	0,009661911	-0,111225635	-0,028710106	Rp (110.730.285)	-Rp606.494.750
01/11/2011	5150	2948900	15.186.835.000	-0,028710106	-0,090151097	-0,028710106	Rp (436.015.643)	
03/10/2011	5300	1822300	9.658.190.000	0,073382546	-0,087011377	-0,028710106	Rp (277.287.659)	
05/09/2011	4925	7475500	36.816.837.500	-0,073382546	-0,073382546	-0,028710106	Rp (1.057.015.307)	
01/08/2011	5300	6318900	33.490.170.000	-0,090151097	-0,06701071	-0,028710106	Rp (961.506.331)	
01/07/2011	5800	4764300	27.632.940.000	0,071458964	-0,066249386	-0,028710106	Rp (793.344.636)	
01/06/2011	5400	4001900	21.610.260.000	0,06701071	-0,028710106	-0,028710106	Rp (620.432.855)	
02/05/2011	5050	4860600	24.546.030.000	-0,06701071	-0,021622464	-0,028710106	Rp (704.719.123)	
01/04/2011	5400	5048400	27.261.360.000	0,018692133	-0,016349138	-0,028710106	Rp (782.676.535)	
01/03/2011	5300	6642100	35.203.130.000	0,147100122	-0,006600684	-0,028710106	Rp (1.010.685.594)	
01/02/2011	4575	5745100	26.283.832.500	0	0	-0,028710106	Rp (754.611.617)	
03/01/2011	4575	10981700	50.241.277.500	-0,021622464	0	-0,028710106	Rp (1.442.432.403)	
01/12/2010	4675	13736400	64.217.670.000	-0,087011377	0,009661911	-0,028710106	Rp (1.843.696.113)	
01/11/2010	5100	9245100	47.150.010.000	-0,111225635	0,018692133	-0,028710106	Rp (1.353.681.785)	
01/10/2010	5700	31974600	182.255.220.000	0,044850566	0,03257617	-0,028710106	Rp (5.232.566.685)	
01/09/2010	5450	28723500	156.543.075.000	0,180488376	0,044850566	-0,028710106	Rp (4.494.368.277)	
02/08/2010	4550	36232400	164.857.420.000	-0,016349138	0,054067221	-0,028710106	Rp (4.733.074.003)	
01/07/2010	4625	15479000	71.590.375.000	0,108368037	0,06701071	-0,028710106	Rp (2.055.367.255)	
01/06/2010	4150	20910800	86.779.820.000	0,128381167	0,071458964	-0,028710106	Rp (2.491.457.831)	
03/05/2010	3650	29529900	107.784.135.000	-0,066249386	0,073382546	-0,028710106	Rp (3.094.493.941)	
01/04/2010	3900	21322100	83.156.190.000	0,03257617	0,108368037	-0,028710106	Rp (2.387.423.029)	
01/03/2010	3775	15456900	58.349.797.500	-0,006600684	0,128381167	-0,028710106	Rp (1.675.228.871)	
01/02/2010	3800	14742600	56.021.880.000	0,054067221	0,147100122	-0,028710106	Rp (1.608.394.113)	
07/01/2010	3600	17543300	63.155.880.000	0	0,180488376	-0,028710106	Rp (1.813.212.009)	

Lampiran 5 Perhitungan VaR JPFA 2 Tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	<i>Time Horizon 30 Hari Kedepan</i>
01/12/2011	3825	1556700	5.954.377.500	-0,162518929	-0,251314428	-0,163629424	Rp (974.311.361)	-Rp5.336.523.102
01/11/2011	4500	716600	3.224.700.000	-0,125163143	-0,163629424	-0,163629424	Rp (527.655.804)	
03/10/2011	5100	1494700	7.622.970.000	0,164828399	-0,162518929	-0,163629424	Rp (1.247.342.190)	
05/09/2011	4325	2116600	9.154.295.000	-0,129912134	-0,129912134	-0,163629424	Rp (1.497.912.018)	
01/08/2011	4925	3793400	18.682.495.000	-0,073382546	-0,125163143	-0,163629424	Rp (3.057.005.896)	
01/07/2011	5300	6434200	34.101.260.000	0,06328145	-0,076372979	-0,163629424	Rp (5.579.969.531)	
01/06/2011	4975	6226500	30.976.837.500	0,175311012	-0,073382546	-0,163629424	Rp (5.068.722.077)	
02/05/2011	4175	4031500	16.831.512.500	0,134387191	-0,040491361	-0,163629424	Rp (2.754.130.695)	
01/04/2011	3650	1486700	5.426.455.000	0,056352937	-0,039845909	-0,163629424	Rp (887.927.706)	
01/03/2011	3450	1572100	5.423.745.000	0,139761942	-0,020000667	-0,163629424	Rp (887.484.270)	
01/02/2011	3000	771800	2.315.400.000	-0,008298803	-0,008298803	-0,163629424	Rp (378.867.568)	
03/01/2011	3025	1680500	5.083.512.500	-0,040491361	0	-0,163629424	Rp (831.812.222)	
01/12/2010	3150	2353700	7.414.155.000	-0,076372979	0,056352937	-0,163629424	Rp (1.213.173.912)	
01/11/2010	3400	8112800	27.583.520.000	0,076372979	0,06328145	-0,163629424	Rp (4.513.475.489)	
01/10/2010	3150	14953800	47.104.470.000	-0,251314428	0,076372979	-0,163629424	Rp (7.707.677.294)	
01/09/2010	4050	20642600	83.602.530.000	0,492476485	0,085655445	-0,163629424	Rp (13.679.833.829)	
02/08/2010	2475	8315700	20.581.357.500	-0,020000667	0,112005058	-0,163629424	Rp (3.367.715.673)	
01/07/2010	2525	10573100	26.697.077.500	0,514131412	0,134387191	-0,163629424	Rp (4.368.427.414)	
01/06/2010	1510	1706500	2.576.815.000	0,112005058	0,139761942	-0,163629424	Rp (421.642.754)	
03/05/2010	1350	1503600	2.029.860.000	-0,163629424	0,164828399	-0,163629424	Rp (332.144.823)	
01/04/2010	1590	2906600	4.621.494.000	0,171064402	0,171064402	-0,163629424	Rp (756.212.401)	
01/03/2010	1340	590400	791.136.000	0,085655445	0,175311012	-0,163629424	Rp (129.453.128)	
01/02/2010	1230	155200	190.896.000	-0,039845909	0,492476485	-0,163629424	Rp (31.236.203)	
07/01/2010	1280	513700	657.536.000	0	0,514131412	-0,163629424	Rp (107.592.237)	

Lampiran 6 Perhitungan VaR TRAM 2 Tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	Time Horizon 30 Hari Kedepan
01/12/2011	990	73891500	73.152.585.000	0,062520357	-0,065597282	-0,058268908	Rp (4.262.521.245)	-Rp23.346.790.379
01/11/2011	930	99833200	92.844.876.000	0,055262679	-0,058268908	-0,058268908	Rp (5.409.969.538)	
03/10/2011	880	73016000	64.254.080.000	0,159848701	-0,052185753	-0,058268908	Rp (3.744.015.076)	
05/09/2011	750	73372500	55.029.375.000	0,292136423	-0,043017385	-0,058268908	Rp (3.206.501.589)	
01/08/2011	560	84436900	47.284.664.000	-0,052185753	-0,032789823	-0,058268908	Rp (2.755.225.736)	
01/07/2011	590	77006300	45.433.717.000	-0,016807118	-0,030771659	-0,058268908	Rp (2.647.373.076)	
01/06/2011	600	70465200	42.279.120.000	0	-0,016807118	-0,058268908	Rp (2.463.558.154)	
02/05/2011	600	71226600	42.735.960.000	0	-0,0104713	-0,058268908	Rp (2.490.177.722)	
01/04/2011	600	26353100	15.811.860.000	0,016807118	-0,010050336	-0,058268908	Rp (921.339.816)	
01/03/2011	590	55711200	32.869.608.000	-0,065597282	0	-0,058268908	Rp (1.915.276.165)	
01/02/2011	630	40300400	25.389.252.000	0,048790164	0	-0,058268908	Rp (1.479.403.989)	
03/01/2011	600	26428000	15.856.800.000	-0,032789823	0	-0,058268908	Rp (923.958.420)	
01/12/2010	620	24379200	15.115.104.000	0,032789823	0	-0,058268908	Rp (880.740.604)	
01/11/2010	600	67438000	40.462.800.000	0	0,016807118	-0,058268908	Rp (2.357.723.171)	
01/10/2010	600	85786200	51.471.720.000	0,033901552	0,032789823	-0,058268908	Rp (2.999.200.917)	
01/09/2010	580	73454500	42.603.610.000	0,071458964	0,033901552	-0,058268908	Rp (2.482.465.832)	
02/08/2010	540	74666500	40.319.910.000	0,037740328	0,037740328	-0,058268908	Rp (2.349.397.126)	
01/07/2010	520	34052900	17.707.508.000	0,133531393	0,048790164	-0,058268908	Rp (1.031.797.155)	
01/06/2010	455	227900	103.694.500	-0,043017385	0,055262679	-0,058268908	Rp (6.042.165)	
03/05/2010	475	864900	410.827.500	-0,0104713	0,062520357	-0,058268908	Rp (23.938.470)	
01/04/2010	480	6130100	2.942.448.000	-0,030771659	0,071458964	-0,058268908	Rp (171.453.232)	
01/03/2010	495	1830300	905.998.500	-0,010050336	0,133531393	-0,058268908	Rp (52.791.543)	
01/02/2010	500	7016100	3.508.050.000	-0,058268908	0,159848701	-0,058268908	Rp (204.410.243)	
07/01/2010	530	17770900	9.418.577.000	0	0,292136423	-0,058268908	Rp (548.810.197)	

Date	Close	Volume	Eksposeure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	<i>Time Horizon 30 Hari Kedepan</i>
01/12/2011	460	57436200	26.420.652.000	0,079137321	-0,234839591	-0,185717146	Rp (4.906.768.085)	-Rp26.875.475.645
01/11/2011	425	93090900	39.563.632.500	-0,023256862	-0,185717146	-0,185717146	Rp (7.347.644.913)	
03/10/2011	435	153854400	66.926.664.000	0,122102697	-0,141226429	-0,185717146	Rp (12.429.429.029)	
05/09/2011	385	105378200	40.570.607.000	-0,087011377	-0,087011377	-0,185717146	Rp (7.534.657.344)	
01/08/2011	420	110803000	46.537.260.000	0	-0,023256862	-0,185717146	Rp (8.642.767.110)	
01/07/2011	420	112953600	47.440.512.000	0,256429529	0	-0,185717146	Rp (8.810.516.493)	
01/06/2011	325	59920500	19.474.162.500	0,047252885	0	-0,185717146	Rp (3.616.685.880)	
02/05/2011	310	69785900	21.633.629.000	0,049596941	0	-0,185717146	Rp (4.017.735.836)	
01/04/2011	295	47215800	13.928.661.000	0,034486176	0,034486176	-0,185717146	Rp (2.586.791.169)	
01/03/2011	285	43141400	12.295.299.000	0,15123097	0,047252885	-0,185717146	Rp (2.283.447.839)	
01/02/2011	245	32513000	7.965.685.000	0	0,049596941	-0,185717146	Rp (1.479.364.284)	
03/01/2011	245	72822600	17.841.537.000	-0,185717146	0,052185753	-0,185717146	Rp (3.313.479.332)	
01/12/2010	295	50453400	14.883.753.000	0,052185753	0,055059777	-0,185717146	Rp (2.764.168.129)	
01/11/2010	280	100743200	28.208.096.000	0,055059777	0,073687716	-0,185717146	Rp (5.238.727.083)	
01/10/2010	265	155794100	41.285.436.500	0,256719847	0,079137321	-0,185717146	Rp (7.667.413.438)	
01/09/2010	205	136720800	28.027.764.000	0,141226429	0,113523826	-0,185717146	Rp (5.205.236.339)	
02/08/2010	178	80992700	14.416.700.600	-0,141226429	0,122102697	-0,185717146	Rp (2.677.428.490)	
01/07/2010	205	107772300	22.093.321.500	0,113523826	0,141226429	-0,185717146	Rp (4.103.108.615)	
01/06/2010	183	91116900	16.674.392.700	0,073687716	0,15123097	-0,185717146	Rp (3.096.720.624)	
03/05/2010	170	233813300	39.748.261.000	-0,234839591	0,187211542	-0,185717146	Rp (7.381.933.591)	
01/04/2010	215	263109800	56.568.607.000	0,2707716	0,221307004	-0,185717146	Rp (10.505.760.245)	
01/03/2010	164	127308200	20.878.544.800	0,187211542	0,256429529	-0,185717146	Rp (3.877.503.753)	
01/02/2010	136	232891000	31.673.176.000	0,221307004	0,256719847	-0,185717146	Rp (5.882.251.851)	
07/01/2010	109	70457000	7.679.813.000	0	0,2707716	-0,185717146	Rp (1.426.272.952)	

Lampiran 8 Perhitungan VaR CPIN 2 tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	<i>Time Horizon 30 Hari Kedepan</i>
01/12/2011	2150	12694500	27.293.175.000	-0,067441281	-0,210989452	-0,151040257	Rp (4.122.368.166)	-Rp22.579.140.350
01/11/2011	2300	13397200	30.813.560.000	-0,151040257	-0,151040257	-0,151040257	Rp (4.654.088.021)	
03/10/2011	2675	17413200	46.580.310.000	0,108480643	-0,136132174	-0,151040257	Rp (7.035.501.994)	
05/09/2011	2400	33434300	80.242.320.000	-0,136132174	-0,09531018	-0,151040257	Rp (12.119.820.635)	
01/08/2011	2750	38797700	106.693.675.000	0,009132484	-0,087011377	-0,151040257	Rp (16.115.040.092)	
01/07/2011	2725	20519200	55.914.820.000	0,314333789	-0,067441281	-0,151040257	Rp (8.445.388.783)	
01/06/2011	1990	19321000	38.448.790.000	0,030614636	-0,048049698	-0,151040257	Rp (5.807.315.123)	
02/05/2011	1930	14932600	28.819.918.000	0	-0,042559614	-0,151040257	Rp (4.352.967.821)	
01/04/2011	1930	14974800	28.901.364.000	-0,048049698	-0,017391743	-0,151040257	Rp (4.365.269.446)	
01/03/2011	2025	37109800	75.147.345.000	0,286859366	0	-0,151040257	Rp (11.350.274.302)	
01/02/2011	1520	22967900	34.911.208.000	0,019934215	0	-0,151040257	Rp (5.272.997.829)	
03/01/2011	1490	22478800	33.493.412.000	-0,210989452	0,009132484	-0,151040257	Rp (5.058.853.556)	
01/12/2010	1840	26088100	48.002.104.000	-0,042559614	0,019934215	-0,151040257	Rp (7.250.250.125)	
01/11/2010	1920	58188800	111.722.496.000	0,115831816	0,030614636	-0,151040257	Rp (16.874.594.509)	
01/10/2010	1710	29765400	50.898.834.000	-0,017391743	0,068992871	-0,151040257	Rp (7.687.772.968)	
01/09/2010	1740	23453300	40.808.742.000	0,299242895	0,108480643	-0,151040257	Rp (6.163.762.880)	
02/08/2010	1290	20096700	25.924.743.000	0,215421505	0,115831816	-0,151040257	Rp (3.915.679.845)	
01/07/2010	1040	34586700	35.970.168.000	0,381711022	0,215421505	-0,151040257	Rp (5.432.943.419)	
01/06/2010	710	31898200	22.647.722.000	0,255346692	0,255346692	-0,151040257	Rp (3.420.717.751)	
03/05/2010	550	23405300	12.872.915.000	-0,087011377	0,286859366	-0,151040257	Rp (1.944.328.390)	
01/04/2010	600	13210100	7.926.060.000	0,068992871	0,299242895	-0,151040257	Rp (1.197.154.139)	
01/03/2010	560	22988000	12.873.280.000	0,336472237	0,314333789	-0,151040257	Rp (1.944.383.520)	
01/02/2010	400	6152800	2.461.120.000	-0,09531018	0,336472237	-0,151040257	Rp (371.728.197)	
07/01/2010	440	15527200	6.831.968.000	0	0,381711022	-0,151040257	Rp (1.031.902.203)	

Lampiran 9 Perhitungan VaR GGRM 2 tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	Time Horizon 30 Hari Kedepan
01/12/2011	62050	701400	43.521.870.000	-0,046446758	-0,158703305	-0,078590275	Rp (3.420.395.732)	-Rp18.734.278.979
01/11/2011	65000	684200	44.473.000.000	0,103652573	-0,078590275	-0,078590275	Rp (3.495.145.300)	
03/10/2011	58600	1032000	60.475.200.000	0,109921527	-0,071227509	-0,078590275	Rp (4.752.762.599)	
05/09/2011	52500	1451900	76.224.750.000	-0,046520016	-0,051192279	-0,078590275	Rp (5.990.524.064)	
01/08/2011	55000	1483300	81.581.500.000	0,077470262	-0,046520016	-0,078590275	Rp (6.411.512.520)	
01/07/2011	50900	1055900	53.745.310.000	0,02184794	-0,046446758	-0,078590275	Rp (4.223.858.693)	
01/06/2011	49800	1028800	51.234.240.000	0,134105281	-0,03032373	-0,078590275	Rp (4.026.513.011)	
02/05/2011	43550	726900	31.656.495.000	0,070141637	-0,018970759	-0,078590275	Rp (2.487.892.648)	
01/04/2011	40600	1243400	50.482.040.000	-0,03032373	-0,017348638	-0,078590275	Rp (3.967.397.406)	
01/03/2011	41850	1209600	50.621.760.000	0,135410611	0	-0,078590275	Rp (3.978.378.039)	
01/02/2011	36550	1517600	55.468.280.000	-0,018970759	0,014727807	-0,078590275	Rp (4.359.267.379)	
03/01/2011	37250	1831400	68.219.650.000	-0,071227509	0,02184794	-0,078590275	Rp (5.361.401.054)	
01/12/2010	40000	1207700	48.308.000.000	-0,017348638	0,023122417	-0,078590275	Rp (3.796.539.005)	
01/11/2010	40700	916600	37.305.620.000	-0,158703305	0,070141637	-0,078590275	Rp (2.931.858.935)	
01/10/2010	47700	1391800	66.388.860.000	-0,078590275	0,077470262	-0,078590275	Rp (5.217.518.764)	
01/09/2010	51600	861300	44.443.080.000	0,269755856	0,081963938	-0,078590275	Rp (3.492.793.879)	
02/08/2010	39400	703300	27.710.020.000	0,118417755	0,103652573	-0,078590275	Rp (2.177.738.092)	
01/07/2010	35000	764900	26.771.500.000	0,023122417	0,108990284	-0,078590275	Rp (2.103.979.547)	
01/06/2010	34200	1133900	38.779.380.000	0,014727807	0,109921527	-0,078590275	Rp (3.047.682.139)	
03/05/2010	33700	2250900	75.855.330.000	0,199682065	0,118417755	-0,078590275	Rp (5.961.491.245)	
01/04/2010	27600	972000	26.827.200.000	0,108990284	0,134105281	-0,078590275	Rp (2.108.357.025)	
01/03/2010	24750	912600	22.586.850.000	-0,051192279	0,135410611	-0,078590275	Rp (1.775.106.753)	
01/02/2010	26050	668000	17.401.400.000	0,081963938	0,199682065	-0,078590275	Rp (1.367.580.811)	
07/01/2010	24000	1114100	26.738.400.000	0	0,269755856	-0,078590275	Rp (2.101.378.209)	

Date	Close	Volume	Eksposeure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	Time Horizon 30 Hari Kedepan
01/12/2011	3000	2487300	7.461.900.000	0,077961541	-0,190043603	-0,158470341	Rp (1.182.489.838)	-Rp6.476.763.580
01/11/2011	2775	2599900	7.214.722.500	0,009049836	-0,158470341	-0,158470341	Rp (1.143.319.535)	
03/10/2011	2750	5792600	15.929.650.000	0,105360516	-0,121607132	-0,158470341	Rp (2.524.377.068)	
05/09/2011	2475	8031800	19.878.705.000	-0,158470341	-0,104140259	-0,158470341	Rp (3.150.185.160)	
01/08/2011	2900	11263000	32.662.700.000	-0,121607132	-0,010929071	-0,158470341	Rp (5.176.069.207)	
01/07/2011	3275	10011800	32.788.645.000	0,046883586	-0,010810916	-0,158470341	Rp (5.196.027.754)	
01/06/2011	3125	7807800	24.399.375.000	0,049190244	0	-0,158470341	Rp (3.866.577.276)	
02/05/2011	2975	13256500	39.438.087.500	0,246524	0	-0,158470341	Rp (6.249.767.175)	
01/04/2011	2325	5558300	12.923.047.500	0,043963123	0,009049836	-0,158470341	Rp (2.047.919.744)	
01/03/2011	2225	9908400	22.046.190.000	0,081917122	0,043963123	-0,158470341	Rp (3.493.667.247)	
01/02/2011	2050	8504700	17.434.635.000	-0,104140259	0,046883586	-0,158470341	Rp (2.762.872.554)	
03/01/2011	2275	13082900	29.763.597.500	-0,010929071	0,049190244	-0,158470341	Rp (4.716.647.445)	
01/12/2010	2300	12754300	29.334.890.000	0	0,077961541	-0,158470341	Rp (4.648.710.021)	
01/11/2010	2300	14057100	32.331.330.000	-0,010810916	0,081917122	-0,158470341	Rp (5.123.556.890)	
01/10/2010	2325	22329300	51.915.622.500	0,160623194	0,105360516	-0,158470341	Rp (8.227.086.401)	
01/09/2010	1980	28118700	55.675.026.000	0,140772554	0,120363682	-0,158470341	Rp (8.822.840.355)	
02/08/2010	1720	46447200	79.889.184.000	0,335310121	0,140772554	-0,158470341	Rp (12.660.066.231)	
01/07/2010	1230	28866500	35.505.795.000	0,237473377	0,160623194	-0,158470341	Rp (5.626.615.441)	
01/06/2010	970	13276800	12.878.496.000	0,120363682	0,214409871	-0,158470341	Rp (2.040.859.653)	
03/05/2010	860	26558800	22.840.568.000	-0,190043603	0,237473377	-0,158470341	Rp (3.619.552.600)	
01/04/2010	1040	35115400	36.520.016.000	0,262364264	0,246524	-0,158470341	Rp (5.787.339.389)	
01/03/2010	800	27210200	21.768.160.000	0,338975367	0,262364264	-0,158470341	Rp (3.449.607.738)	
01/02/2010	570	7378600	4.205.802.000	0,214409871	0,335310121	-0,158470341	Rp (666.494.877)	
07/01/2010	460	1748200	804.172.000	0	0,338975367	-0,158470341	Rp (127.437.411)	

Lampiran 11 Perhitungan VaR JSMR 2 tahun

Date	Close	Volume	Eksposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	Time Horizon 30 Hari Kedepan
01/12/2011	4200	7589600	31.876.320.000	0,080538862	-0,132489183	-0,076161361	Rp (2.427.743.915)	-Rp13.297.301.060
01/11/2011	3875	3366100	13.043.637.500	0,006472515	-0,076161361	-0,076161361	Rp (993.421.184)	
03/10/2011	3850	7207200	27.747.720.000	-0,0319516	-0,051927611	-0,076161361	Rp (2.113.304.120)	
05/09/2011	3975	10851500	43.134.712.500	-0,006269613	-0,0319516	-0,076161361	Rp (3.285.198.410)	
01/08/2011	4000	11690700	46.762.800.000	0,006269613	-0,029852963	-0,076161361	Rp (3.561.518.492)	
01/07/2011	3975	8715100	34.642.522.500	0,09217046	-0,014493007	-0,076161361	Rp (2.638.421.662)	
01/06/2011	3625	8881500	32.195.437.500	0,042259809	-0,011173301	-0,076161361	Rp (2.452.048.338)	
02/05/2011	3475	9112500	31.665.937.500	0,051672011	-0,006269613	-0,076161361	Rp (2.411.720.897)	
01/04/2011	3300	8336600	27.510.780.000	-0,029852963	0	-0,076161361	Rp (2.095.258.447)	
01/03/2011	3400	8616500	29.296.100.000	0,068467799	0,005602256	-0,076161361	Rp (2.231.230.848)	
01/02/2011	3175	5446000	17.291.050.000	0,056695344	0,006269613	-0,076161361	Rp (1.316.909.901)	
03/01/2011	3000	9442700	28.328.100.000	-0,132489183	0,006472515	-0,076161361	Rp (2.157.506.651)	
01/12/2010	3425	6463200	22.136.460.000	-0,014493007	0,027536158	-0,076161361	Rp (1.685.942.921)	
01/11/2010	3475	12443600	43.241.510.000	-0,076161361	0,042259809	-0,076161361	Rp (3.293.332.253)	
01/10/2010	3750	8248300	30.931.125.000	0,15860503	0,051672011	-0,076161361	Rp (2.355.756.577)	
01/09/2010	3200	9307800	29.784.960.000	0,089856329	0,056695344	-0,076161361	Rp (2.268.463.091)	
02/08/2010	2925	8298500	24.273.112.500	0,0893451	0,068467799	-0,076161361	Rp (1.848.673.284)	
01/07/2010	2675	13118900	35.093.057.500	0,27837968	0,080538862	-0,076161361	Rp (2.672.735.021)	
01/06/2010	2025	9458600	19.153.665.000	0,027536158	0,0893451	-0,076161361	Rp (1.458.769.195)	
03/05/2010	1970	11437400	22.531.678.000	-0,051927611	0,089856329	-0,076161361	Rp (1.716.043.262)	
01/04/2010	2075	34120300	70.799.622.500	0,147745534	0,09217046	-0,076161361	Rp (5.392.195.608)	
01/03/2010	1790	7476900	13.383.651.000	0,005602256	0,147745534	-0,076161361	Rp (1.019.317.075)	
01/02/2010	1780	2581000	4.594.180.000	-0,011173301	0,15860503	-0,076161361	Rp (349.899.001)	
07/01/2010	1800	7224200	13.003.560.000	0	0,27837968	-0,076161361	Rp (990.368.827)	

Lampiran 12 Perhitungan VaR KLBF 2 tahun

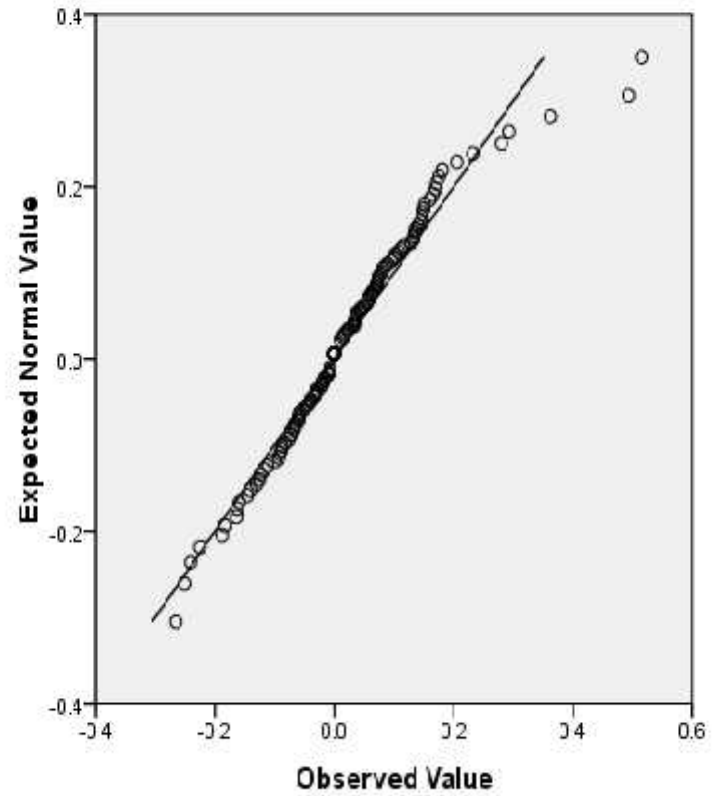
Date	Close	Volume	Exposure	Return	Peringkat Return	Percentile	Prediksi VaR	30
01/12/2011	680	21559300	14.660.324.000	-0,036105005	-0,140146632	-0,098689377	Rp (1.446.818.242)	-Rp7.924.549.879
01/11/2011	705	30723900	21.660.349.500	0,014285957	-0,098689377	-0,098689377	Rp (2.137.646.398)	
03/10/2011	695	41944100	29.151.149.500	0,066939483	-0,074107972	-0,098689377	Rp (2.876.908.783)	
05/09/2011	650	60517000	39.336.050.000	-0,066939483	-0,066939483	-0,098689377	Rp (3.882.050.268)	
01/08/2011	695	48511500	33.715.492.500	0	-0,057569852	-0,098689377	Rp (3.327.360.950)	
01/07/2011	695	76494600	53.163.747.000	0,029199155	-0,052367986	-0,098689377	Rp (5.246.697.070)	
01/06/2011	675	47419300	32.008.027.500	-0,057569852	-0,036105005	-0,098689377	Rp (3.158.852.293)	
02/05/2011	715	78010700	55.777.650.500	0	0	-0,098689377	Rp (5.504.661.578)	
01/04/2011	715	78484000	56.116.060.000	0,050189745	0	-0,098689377	Rp (5.538.059.001)	
01/03/2011	680	95270500	64.783.940.000	0,150480951	0	-0,098689377	Rp (6.393.486.678)	
01/02/2011	585	44621300	26.103.460.500	0,034786116	0,012903405	-0,098689377	Rp (2.576.134.254)	
03/01/2011	565	116401400	65.766.791.000	-0,140146632	0,014285957	-0,098689377	Rp (6.490.483.631)	
01/12/2010	650	148737800	96.679.570.000	-0,074107972	0,029199155	-0,098689377	Rp (9.541.246.532)	
01/11/2010	700	258920200	181.244.140.000	0,268813588	0,034786116	-0,098689377	Rp (17.886.871.262)	
01/10/2010	535	113846300	60.907.770.500	0,047856021	0,047856021	-0,098689377	Rp (6.010.949.925)	
01/09/2010	510	109820200	56.008.302.000	0,09237332	0,050189745	-0,098689377	Rp (5.527.424.431)	
02/08/2010	465	77527500	36.050.287.500	-0,052367986	0,066939483	-0,098689377	Rp (3.557.780.414)	
01/07/2010	490	192387900	94.270.071.000	0,15415068	0,09237332	-0,098689377	Rp (9.303.454.577)	
01/06/2010	420	172322100	72.375.282.000	0,110665568	0,104022723	-0,098689377	Rp (7.142.671.491)	
03/05/2010	376	313234400	117.776.134.400	-0,098689377	0,110665568	-0,098689377	Rp (11.623.253.329)	
01/04/2010	415	324139200	134.517.768.000	0,104022723	0,150480951	-0,098689377	Rp (13.275.474.719)	
01/03/2010	374	299305700	111.940.331.800	0,18125261	0,15415068	-0,098689377	Rp (11.047.321.607)	
01/02/2010	312	136121700	42.469.970.400	0,012903405	0,18125261	-0,098689377	Rp (4.191.334.920)	
07/01/2010	308	139457200	42.952.817.600	0	0,268813588	-0,098689377	Rp (4.238.986.809)	

One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Return
N		125
Normal Parameters ^a	Mean	.02274497
	Std. Deviation	.12716269
		75622
Most Extreme Differences	Absolute	.067
	Positive	.067
	Negative	-.047
Kolmogorov-Smirnov Z		.749
Asymp. Sig. (2-tailed)		.629

a. Test distribution is Normal.

Normal Q-Q Plot of Return

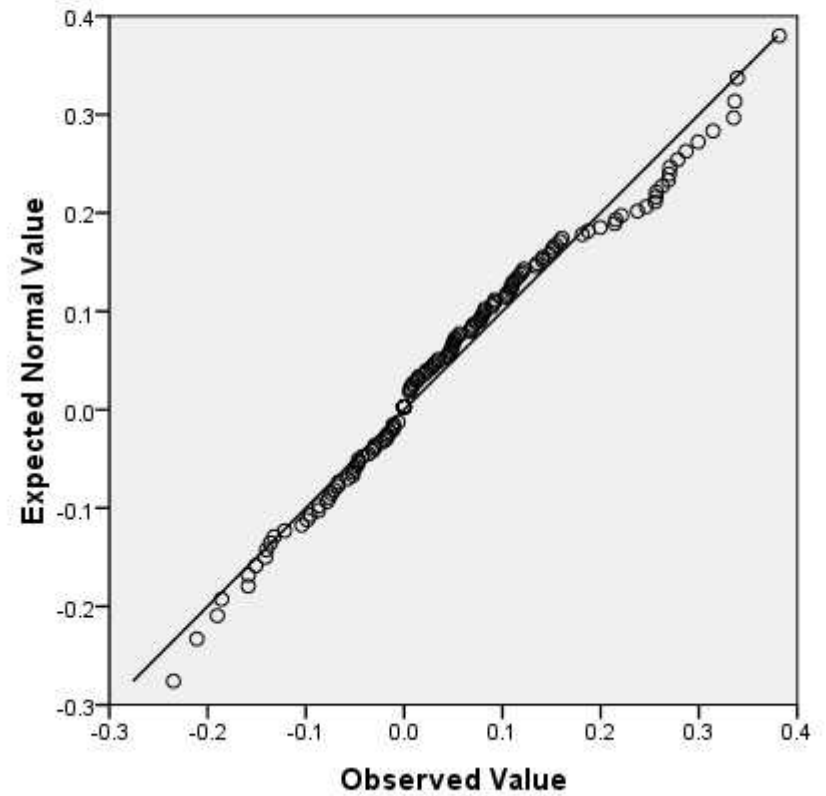


One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Return
N		144
Normal Parameters ^a	Mean	.05201837
	Std. Deviation	.12493922
		53071
Most Extreme Differences	Absolute	.069
	Positive	.069
	Negative	-.052
Kolmogorov-Smirnov Z		.827
Asymp. Sig. (2-tailed)		.501

a. Test distribution is Normal.

Normal Q-Q Plot of Return



Paired Samples Statistics

		Mean	N	Std. Deviation	Std. Error Mean
Pair 1	JII	-7.103488239576E9	125	1.7858802445125E10	1.5973398505616E9
	LQ45	-4.240037116944E9	125	3.0020965287854E9	2.6851567653521E8

Paired Samples Test

		Paired Differences				t	df	Sig. (2-tailed)	
		Mean	Std. Deviation	Std. Error Mean	95% Confidence Interval of the Difference				
					Lower				Upper
Pair 1	JII - LQ45	2.8634511226320E9	1.6653890603717E10	1.4895692591902E9	5.8117259396524E9	8.4823694388377E7	-1.922	124	.057