

LAMPIRAN 1
DAFTAR EMITEN PERUSAHAAN PADA JII
PERIODE JUNI-NOVEMBER
TAHUN 2018

No.	Kode Perusahaan	Nama Perusahaan
1	ADRO	Adaro Energy Tbk.
2	AKRA	AKR Corporindo Tbk.
3	ANTM	Aneka Tambang Tbk.
4	ASII	Astra International Tbk.
5	BRPT	Barito Pacific Tbk.
6	BSDE	Bumi Serpong Damai Tbk.
7	CTRA	Ciputra Development Tbk.
8	EXCL	XL Axiata Tbk.
9	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.
10	INCO	Vale Indonesia Tbk.
11	INDY	Indika Energy Tbk
12	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk.
13	INTP	Indocement Tunggul Prakarsa tbk.
14	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk.
15	KLBF	Kalbe Farma Tbk.
16	LPKR	Lippo Karawaci Tbk
17	LPPF	Matahari Department Store Tbk.
18	PGAS	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk.
19	PTBA	Bukit Asam Tbk.
20	PTPP	PP (Persero) Tbk.
21	SCMA	Surya Citra Media Tbk.
22	SMGR	Semen Indonesia (Persero) Tbk.
23	SMRA	Summarecon Agung Tbk.
24	TLKM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk.
25	TPIA	Chandra Asri Petrochemical Tbk.
26	UNTR	United Tractors Tbk.
27	UNVR	Unilever Indonesia Tbk.
28	WIKA	Wijaya Karya (Persero) Tbk.
29	WSBP	Waskita Beton Precast Tbk
30	WSKT	Waskita Karya (Persero) Tbk

LAMPIRAN 2
HARGA SAHAM SYARIAH SEBELUM DAN SESUDAH PELEMAHAN NILAI TUKAR RUPIAH
TERHADAP DOLAR AS
TAHUN 2018

NO.	KODE PERUSAHAAN	t-5	t-4	t-3	t-2	t-1	RATA2 SEBELUM	t+1	t+2	t+3	t+4	t+5	RATA2 SESUDAH
1	ADRO	1825	1810	1750	1730	1780	1779	1710	1675	1750	1760	1730	1725
2	AKRA	3890	3800	3800	3820	3880	3838	3740	3500	3540	3600	3620	3600
3	ANTM	800	800	810	810	820	808	795	765	760	780	765	773
4	ASII	7075	6950	6850	7025	6950	6970	6850	6850	6975	7025	7025	6945
5	BRPT	1620	1625	1625	1720	1755	1669	1800	1760	1780	1790	1790	1784
6	BSDE	1035	1005	1005	1000	1005	1010	990	995	1025	1090	1100	1040
7	CTRA	785	770	800	810	800	793	805	810	805	830	855	821
8	EXCL	2790	2870	2930	2880	2830	2860	2770	2760	2790	2830	2830	2796
9	ICBP	8825	8800	8825	8875	8625	8790	8725	8725	8750	8800	8850	8770
10	INCO	3420	3540	3450	3400	3530	3468	3360	3250	3140	3260	3200	3242
11	INDY	2740	2740	2700	2720	2790	2738	2650	2520	2570	2590	2530	2572
12	INDF	5900	5775	5575	5600	5700	5710	5575	5525	5650	6000	6100	5770
13	INTP	15700	15850	16250	16750	16900	16290	16900	16925	16900	16875	16600	16840
14	ITMG	25675	25675	26250	25750	25500	25770	24950	24725	25225	26000	26000	25380
15	KLBF	1300	1265	1290	1250	1285	1278	1270	1285	1350	1360	1365	1326
16	LPKR	316	310	310	304	304	308,8	298	290	274	288	274	284,8
17	LPPF	6550	6475	6700	6525	6275	6505	5975	6000	6050	6150	5900	6015
18	PGAS	2290	2200	2220	2120	2250	2216	2120	2040	2200	2310	2230	2180
19	PTBA	4710	4740	4690	4500	4540	4636	4560	4440	4390	4500	4490	4476
20	PTPP	1570	1545	1545	1545	1660	1573	1600	1545	1545	1560	1550	1560
21	SCMA	1730	1720	1700	1740	1740	1726	1775	1770	1815	1865	1785	1802
22	SMGR	8850	8925	9300	9300	9125	9100	8900	8825	8975	9000	9000	8940
23	SMRA	575	555	575	595	610	582	595	590	570	600	610	593
24	TLKM	3600	3530	3520	3590	3600	3568	3680	3660	3780	3900	3760	3756
25	TPIA	4530	4530	4560	4570	4560	4550	4540	4550	4530	4520	4510	4530
26	UNTR	31925	32600	32075	32000	32300	32180	31675	31450	31750	32000	31925	31760
27	UNVR	43025	42675	44200	44400	44900	43840	44300	43600	45600	45000	44600	44620
28	WIKA	1350	1310	1300	1300	1305	1313	1290	1285	1270	1270	1255	1274
29	WSBP	352	350	350	348	358	351,6	348	340	338	342	338	341,2
30	WSKT	1660	1645	1640	1640	1645	1646	1615	1570	1580	1575	1550	1578

LAMPIRAN 3
ABNORMAL RETURN SEBELUM DAN SESUDAH PELEMAHAN NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP DOLAR AS
TAHUN 2018

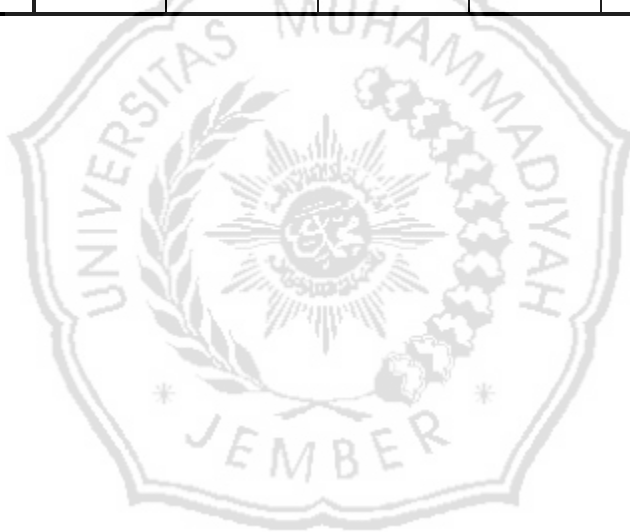
No.	Kode Perusahaan	t-5	t-4	t-3	t-2	t-1	Sebelum AR	t+1	t+2	t+3	t+4	t+5	Sesudah AR
1	ADRO	-0,03085	-0,01205	0,008887	-0,00272	-0,02128	-0,0116026	0,026348	0,042696	-0,00707	-0,01671	0,00882	0,0108168
2	AKRA	0,003544	0,03767	0,02603	-0,00218	-0,00819	0,0113748	0,036543	0,101544	0,083516	0,061576	0,064324	0,0695006
3	ANTM	0,00793	0,01892	-0,00483	-0,02728	-0,03025	-0,007102	0,007921	0,041974	0,042964	0,01243	0,040744	0,0292066
4	ASII	-0,02279	0,005296	0,007782	-0,03964	-0,01994	-0,0138584	0,002252	-0,00242	-0,02577	-0,03668	-0,0281	-0,0181436
5	BRPT	0,137719	0,145362	0,133722	0,049572	0,038071	0,10088922	0,0205	0,038557	0,021306	0,011607	0,020187	0,0224314
6	BSDE	-0,04095	-0,00213	-0,01377	-0,03194	-0,02737	-0,023232	-0,00475	-0,01432	-0,10847	-0,10866	-0,10881	-0,0570026
7	CTRA	0,071266	0,102605	0,05103	0,015406	0,03743	0,0555474	0,039134	0,028118	0,028704	-0,00603	-0,02634	0,01271712
8	EXCL	0,012343	-0,00414	-0,0354	-0,04208	-0,01584	-0,0170234	0,01328	0,012207	-0,00427	-0,02225	-0,01367	-0,0029406
9	ICBP	-0,00165	0,012102	-0,0023	-0,03074	0,006633	-0,003191	0,003308	-0,00136	-0,00993	-0,01955	-0,01647	-0,0088004
10	INCO	0,009136	-0,01318	-0,0057	-0,0087	-0,03573	-0,01083433	0,0205	0,049676	0,080134	0,036695	0,0646	0,05032094
11	INDY	0,001133	0,012123	0,014919	-0,01532	-0,03058	-0,003545	0,028047	0,075354	0,048981	0,036908	0,069936	0,0518452
12	INDF	-0,03688	-0,00562	0,017061	-0,01033	-0,01827	-0,0108078	0,011531	0,01583	-0,01205	-0,07315	-0,07966	-0,0274998
13	INTP	0,076043	0,077102	0,039876	-0,01336	-0,01272	0,0333882	-0,00465	-0,01076	-0,01508	-0,01768	0,00707	-0,00822
14	ITMG	-0,00058	0,010406	-0,02254	-0,02704	-0,00816	-0,0095828	0,021502	0,025941	0,000159	-0,0334	-0,02482	-0,0021236
15	KLBF	-0,00794	0,029765	-0,0011	0,00706	-0,01092	0,003373	-0,00869	-0,00752	-0,0603	-0,07119	-0,06599	-0,0427378
16	LPKR	-0,01129	0,018315	0,006675	0,00306	0,01243	0,005838	0,040634	0,064104	0,119559	0,061576	0,124089	0,0819924
17	LPPF	-0,05729	-0,03569	-0,07845	-0,0774	-0,03139	-0,056044	0,024684	0,01583	0,001806	-0,01837	0,031549	0,0110998
18	PGAS	-0,03882	0,010397	-0,01001	0,012494	-0,03646	-0,0124798	0,029934	0,06485	-0,0172	-0,6757	-0,02576	-0,1247752
19	PTBA	-0,02428	-0,01929	-0,02088	-0,00361	-0,00299	-0,01421	0,000763	0,022587	0,028293	-0,00065	0,010146	0,0122278
20	PTPP	0,029865	0,057087	0,045447	0,022477	0,063635	0,0437022	0,004875	0,035247	0,029487	0,015635	0,030729	0,0231946
21	SCMA	0,02668	0,043552	0,043677	-0,00269	0,006683	0,0235804	-0,00485	-0,00677	-0,03676	-0,06637	-0,01621	-0,026192
22	SMGR	0,03233	0,034869	-0,01698	-0,03995	-0,01223	-0,0003922	0,0205	0,024329	0,006713	-0,00509	0,003489	0,0099882
23	SMRA	0,061463	0,109742	0,060813	0,00306	-0,01216	0,0445836	0,0205	0,024305	0,05393	-0,00231	-0,00999	0,017287
24	TLKM	0,018347	0,049001	0,040235	-0,00251	0,004097	0,021834	-0,00939	-0,00876	-0,04549	-0,0786	-0,03593	-0,035634
25	TPIA	-0,03551	0,00883	0,028223	0,00306	0,014623	0,0038452	0,027108	0,020226	0,0189	0,017082	0,027904	0,022244
26	UNTR	0,010235	0,00086	0,004986	-0,01579	-0,01543	-0,0030278	0,01818	0,01424	-0,00095	-0,01273	-0,00184	0,00338
27	UNVR	0,051665	0,071062	0,023768	-0,0037	-0,00539	0,027481	0,015985	0,027298	-0,02282	-0,00509	0,003389	0,0037524
28	WIKA	-0,03258	0,007136	0,002953	-0,02002	-0,01439	-0,0113802	0,004996	0,004157	0,01007	0,00602	0,026552	0,010359
29	WSBP	0,009635	0,026241	0,020316	0,00269	-0,02109	0,0075584	0,014753	0,033477	0,033739	0,017716	0,038269	0,0275908
30	WSKT	-0,02452	-0,00488	-0,0136	-0,03657	-0,03012	-0,021938	-0,00427	0,018995	0,006905	0,00602	0,030729	0,0116758

LAMPIRAN 4
TRADING VOLUME ACTIVITY SEBELUM DAN SESUDAH PELEMAHAN NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP DOLAR AS
TAHUN 2018

No.	Kode Perusahaan	TV-5	TVA-4	TVA-3	TVA-2	TVA-1	SEBELUM TVA	TVA+1	TVA+2	TVA+3	TVA+4	TVA+5	SESUDAH TVA
1	ADRO	0,000988	0,001057	0,001475	0,00094	0,001062	0,001104445	0,00099	0,000748	0,001301	0,000914	0,000729	0,000936471
2	AKRA	0,001831	0,001895	0,002426	0,00296	0,001766	0,002175558	0,002601	0,003545	0,002444	0,002207	0,001735	0,002506502
3	ANTM	0,002704	0,001339	0,00281	0,000908	0,001491	0,001850411	0,002114	0,004293	0,001414	0,002125	0,00256	0,002501374
4	ASII	0,000487	0,000642	0,000473	0,000429	0,000422	0,000490563	0,00071	0,000465	0,000458	0,000576	0,000311	0,000504193
5	BRPT	0,000573	0,000246	0,000222	0,00071	0,000713	0,000492889	0,000338	0,000513	0,000241	0,000251	0,00011	0,000290762
6	BSDE	0,001078	0,000985	0,000727	0,000985	0,001452	0,001045314	0,001022	0,000956	0,000606	0,001403	0,001033	0,001004169
7	CTRA	0,000574	0,000465	0,00074	0,000383	0,000291	0,000490751	0,000301	0,000432	0,000383	0,000679	0,000189	0,000396717
8	EXCL	0,000613	0,000808	0,000943	0,001494	0,000929	0,000957395	0,001462	0,00026	0,000232	0,000819	0,000436	0,000641772
9	ICBP	0,000744	0,00028	0,00053	0,0002	0,000362	0,000423293	0,000224	0,000158	0,000109	0,00027	6,77E-05	0,000165703
10	INCO	0,001622	0,001403	0,000583	0,00073	0,001379	0,001143351	0,001384	0,000726	0,001827	0,001417	0,000532	0,001177073
11	INDY	0,002098	0,00154	0,0009	0,001035	0,002696	0,001653789	0,001695	0,00173	0,00147	0,001539	0,001406	0,001567885
12	INDF	0,00046	0,000632	0,001502	0,000912	0,001054	0,00091194	0,000757	0,000587	0,000659	0,00132	0,000813	0,000827087
13	INTP	0,000548	0,000347	0,000661	0,000374	0,000274	0,000440749	0,000587	0,000269	0,00018	0,000658	0,000116	0,000361987
14	ITMG	0,000631	0,000792	0,001125	0,001051	0,001306	0,000981145	0,000799	0,000546	0,000944	0,001171	0,001895	0,001070921
15	KLBF	0,000404	0,000352	0,00033	0,000264	0,000299	0,000329748	0,000359	0,000298	0,000311	0,000245	0,000249	0,000292536
16	LPKR	0,000325	0,000419	0,000109	0,000485	0,001356	0,000538914	0,000221	0,001862	0,002245	0,00321	0,001617	0,00183109
17	LPPF	0,000926	0,001791	0,000995	0,001471	0,001744	0,00138557	0,002839	0,002131	0,003137	0,001175	0,002192	0,002294849
18	PGAS	0,003373	0,00291	0,004036	0,003752	0,004985	0,003811236	0,005873	0,003597	0,005908	0,005627	0,003724	0,004945795
19	PTBA	0,002908	0,002377	0,001236	0,001288	0,002011	0,001964044	0,002553	0,001744	0,001997	0,006815	0,001624	0,002946628
20	PTPP	0,00253	0,001385	0,001212	0,001117	0,004252	0,002099086	0,001893	0,002043	0,001646	0,007099	0,000898	0,002715794
21	SCMA	0,001864	0,000868	0,001785	0,000578	0,000541	0,001126844	0,000585	0,00065	0,001071	0,001615	0,003035	0,001391131
22	SMGR	0,001294	0,000992	0,002022	0,001292	0,001221	0,001364136	0,001449	0,000836	0,000649	0,000797	0,000773	0,000900889
23	SMRA	0,00114	0,001357	0,001116	0,002678	0,001595	0,00157725	0,001558	0,000884	0,001434	0,001493	0,000768	0,001227205
24	TLKM	0,000833	0,000598	0,000726	0,000593	0,000322	0,000614467	0,000888	0,000691	0,00099	0,001241	0,001033	0,00096876
25	TPIA	0,000135	0,000168	0,00038	0,000221	0,000106	0,000201953	0,000116	0,000109	0,000144	0,000125	0,000109	0,000120671
26	UNTR	0,00123	0,000866	0,000917	0,001008	0,001097	0,00102362	0,000838	0,00043	0,000798	0,000801	0,000515	0,00067626
27	UNVR	0,00042	0,000312	0,000314	0,000154	0,000149	0,000269483	0,000204	0,000138	0,000201	0,000174	0,000247	0,000192841
28	WIKA	0,001261	0,00145	0,000832	0,000729	0,002438	0,001342005	0,000593	0,00124	0,001267	0,001467	0,002206	0,001354364
29	WSBP	0,001545	0,001199	0,000787	0,000671	0,001608	0,001162168	0,001309	0,001728	0,000637	0,000701	0,000587	0,000992343
30	WSKT	0,0047	0,001469	0,001045	0,000699	0,002079	0,001998401	0,001465	0,001149	0,001682	0,001331	0,001324	0,001390094

LAMPIRAN 5
Descriptive Statistics Harga Saham Syaiah

	<i>N</i>	<i>Minimum</i>	<i>Maximum</i>	<i>Mean</i>		<i>Std. Deviation</i>
	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Std. Error</i>	<i>Statistic</i>
HargaSebelum	30	308,80	43840,00	6595,54 67	1853,26 420	10150,7460 8
HargaSesudah	30	284,80	44620,00	6569,80 00	1864,66 790	10213,2066 9
<i>Valid N (listwise)</i>	30					



LAMPIRAN 6
Descriptive Statistics Abnormal Return

	<i>N</i>	<i>Minimum</i>	<i>Maximum</i>	<i>Mean</i>		<i>Std. Deviation</i>
	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Std. Error</i>	<i>Statistic</i>
ARSebelum	30	-0,06	0,10	0,0051	0,00538	0,02948
ARSesudah	30	-0,12	0,08	0,0043	0,00715	0,03915
Valid N (listwise)	30					



LAMPIRAN 7

Descriptive Statistics Trading Volume Activity

	<i>N</i>	<i>Minimum</i>	<i>Maximum</i>	<i>Mean</i>		<i>Std. Deviation</i>
	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Statistic</i>	<i>Std. Error</i>	<i>Statistic</i>
TVASebelum	30	0,00	0,00	0,0012	0,00014	0,00076
TVASesudah	30	0,00	0,00	0,0013	0,00019	0,00105
Valid N (listwise)	30					



LAMPIRAN 8

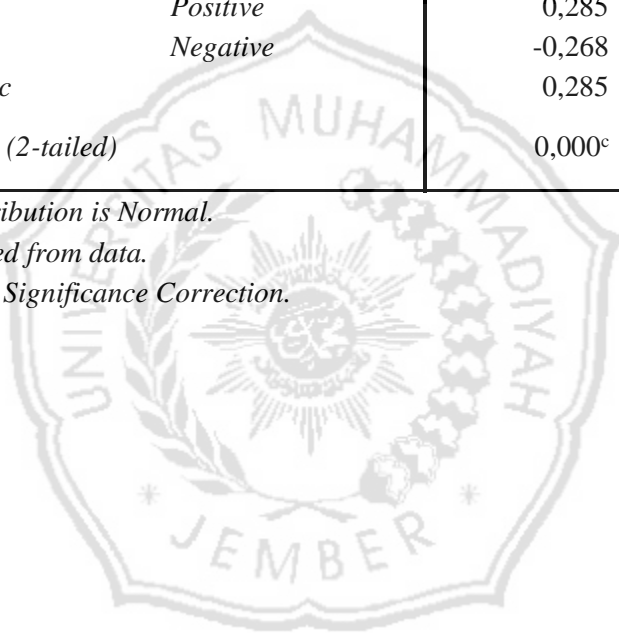
One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test Harga Saham Syariah

		Sebelum Hrga	Sesudah Hrga
N		30	30
<i>Normal Parameters^{a,b}</i>	<i>Mean</i>	6595,547	6569,8
	<i>Std. Deviation</i>	10150,7461	10213,2067
<i>Most Extreme Differences</i>	<i>Absolute</i>	0,285	0,288
	<i>Positive</i>	0,285	0,288
	<i>Negative</i>	-0,268	-0,269
<i>Test Statistic</i>		0,285	0,288
<i>Asymp. Sig. (2-tailed)</i>		0,000 ^c	0,000 ^c

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

c. Lilliefors Significance Correction.



LAMPIRAN 9

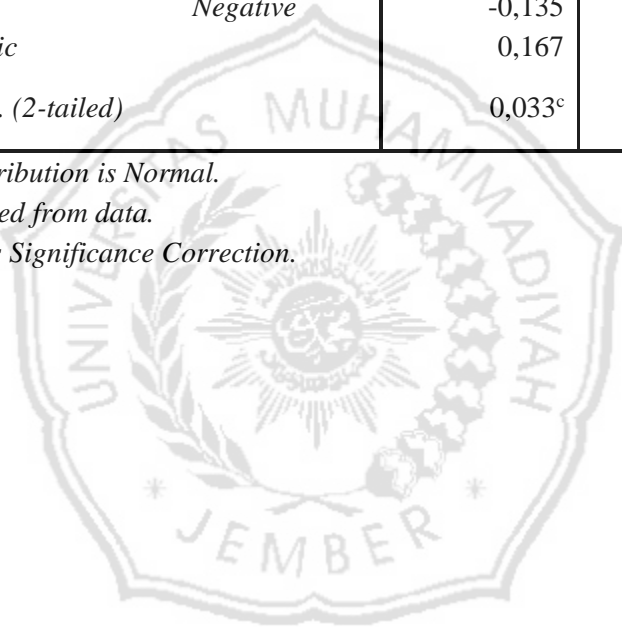
One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test Abnormal Return

		Sebelum AR	Sesudah AR
N		30	30
<i>Normal Parameters^{a,b}</i>	<i>Mean</i>	0,00509147	0,004252029
	<i>Std. Deviation</i>	0,029482692	0,039147957
<i>Most Extreme Differences</i>	<i>Absolute</i>	0,167	0,136
	<i>Positive</i>	0,167	0,129
	<i>Negative</i>	-0,135	-0,136
<i>Test Statistic</i>		0,167	0,136
<i>Asymp. Sig. (2-tailed)</i>		0,033 ^c	0,164 ^c

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

c. Lilliefors Significance Correction.



LAMPIRAN 10

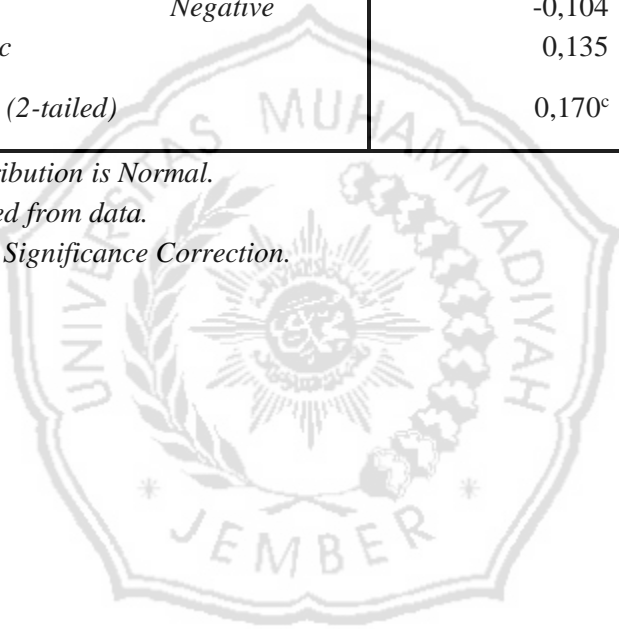
One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test Trading Volume Activity

		SEBELUM TVA	SESUDAH TVA
N		30	30
<i>Normal Parameters^{a,b}</i>	<i>Mean</i>	0,001165684	0,001273129
	<i>Std. Deviation</i>	0,000764886	0,00105399
<i>Most Extreme Differences</i>	<i>Absolute</i>	0,135	0,189
	<i>Positive</i>	0,135	0,189
	<i>Negative</i>	-0,104	-0,137
<i>Test Statistic</i>		0,135	0,189
<i>Asymp. Sig. (2-tailed)</i>		0,170 ^c	0,008 ^c

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

c. Lilliefors Significance Correction.



LAMPIRAN 11
Paired Samples Test Harga Saham Syariah

		Paired Differences				<i>t</i>	<i>df</i>	Sig. (2-tailed)	
		<i>Mean</i>	<i>Std. Deviation</i>	<i>Std. Error Mean</i>	95% Confidence Interval of the Difference				
					<i>Lower</i>				<i>Upper</i>
<i>Pair 1</i>	Sblm Hrga – Ssdh Hrga	25,7467	243,9686	44,5424	-65,3527	116,846	0,578	29	0,568



LAMPIRAN 12

Paired Samples Test Abnormal Return

		<i>Paired Differences</i>					<i>t</i>	<i>Df</i>	<i>Sig. (2-tailed)</i>
		<i>Mean</i>	<i>Std. Deviation</i>	<i>Std. Error Mean</i>	<i>95% Confidence Interval of the Difference</i>				
					<i>Lower</i>	<i>Upper</i>			
<i>Pair 1</i>	Sblm AR - Ssdh AR	0,0008 39	0,0451 72	0,0082 47153	- 0,0160 2788	0,0177 06763	0,102	29	0,92



LAMPIRAN 13

Paired Samples Test Trading Volume Activity

	<i>Paired Differences</i>					<i>t</i>	<i>df</i>	<i>Sig. (2-tailed)</i>
	<i>Mean</i>	<i>Std. Deviation</i>	<i>Std. Error Mean</i>	<i>95% Confidence Interval of the Difference</i>				
				<i>Lower</i>	<i>Upper</i>			
<i>Pair 1</i> Sblm TVA - Ssdah TVA	- 0,000 11	0,0004 79161	0,0000 87482	- 0,0002 8637	0,0000 71476	- 1,228	29	0,229

