

## Lampiran 1 : Durasi dan Dispersi Reksadana

31/12/2006

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Reksadana DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Ekspektasi Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2007	2.601.691.401,78	11,25%	2.338.599.013	5,88%	0,0588	15.203.280.586,7206
2	2008	4.555.000.857,15	11,25%	3.680.344.084	9,25%	0,1850	8.838.717.477,1943
3	2009	4.873.812.785,72	11,25%	3.539.718.975	8,90%	0,2669	1.069.635.822,6969
4	2010	46.305.301.142,86	11,25%	30.229.477.057	75,98%	3,0390	6.129.363.601,1711
				39.788.139.129			31.240.997.487,783
				Durasi Reksadana (D)		3,550	
				Dispersi		0,785	

31/12/2007

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Reksadana DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Ekspektasi Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2008	4.555.000.857,15	11,25%	4.094.382.793	9,83%	0,0983	11.957.417.824,9255
2	2009	4.873.812.785,72	11,25%	3.937.937.360	9,45%	0,1890	1.979.139.976,8903
3	2010	46.305.301.142,86	11,25%	33.630.293.226	80,72%	2,4216	2.849.201.179,5485
				41.662.613.379			16.785.758.981,3643
				Durasi Reksadana (D)		2,7089	
				Dispersi		0,4029	

31/12/2008

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Reksadana DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Ekspektasi Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2009	4.873.812.785,72	11,25%	4.380.955.313	10,48%	0,1048	3.510.659.018,2803
2	2010	46.305.301.142,86	11,25%	37.413.701.214	89,52%	1,7904	411.080.427,2049
				41.794.656.527			3.921.739.445
				Durasi Reksadana (D)		1,8952	
				Dispersi		0,0938	

31/12/2009

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Reksadana DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Ekspektasi Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2010	46.305.301.142,86	11,25%	41.622.742.600	100,00%	1,0000	-
				41.622.742.600			-
				Durasi Reksadana (D)		1,0000	
				Dispersi		-	

## Lampiran 2 : Durasi dan Dispersi Deposito

31/12/2006

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Deposito DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2007	2.806.200.000,00	11,25%	2.522.426.966	11,98%	0,1198	15.567.704.773,5362
2	2008	1.275.000.000,00	11,25%	1.030.172.958	4,89%	0,0979	2.269.603.635,1430
3	2009	1.689.125.000,00	11,25%	1.226.766.000	5,83%	0,1749	287.726.548,3761
4	2010	24.919.625.000,00	11,25%	16.268.271.961	77,29%	3,0917	4.326.590.239,6383
				21.047.637.884			22.451.625.197
				Durasi (D)	3,4843		
				Dispersi	1,0667		

31/12/2007

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Deposito DPPK PT. ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2008	1.275.000.000	11,25%	1.146.067.416	5,56%	0,0556	3.806.921.073,7977
2	2009	1.689.125.000	11,25%	1.364.777.175	6,62%	0,1324	923.415.179,8730
3	2010	24.919.625.000	11,25%	18.098.452.556	87,82%	2,6345	569.828.415,5221
				20.609.297.146			5.300.164.669
				Durasi (D)	2,8226		
				Dispersi	0,2572		

31/12/2008

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Deposito DPPK PT. ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2009	1.689.125.000	11,25%	1.518.314.607	7,01%	0,0701	1.312.849.187,8411
2	2010	24.919.625.000	11,25%	20.134.528.469	92,99%	1,8598	98.999.989,0712
				21.652.843.075			1.411.849.177
				Durasi (D)	1,9299		
				Dispersi	0,0652		

31/12/2009

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Deposito DPPK PT. ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2010	24.919.625.000	11,84%	22.280.795.858	100,00%	1,0000	-
				22.280.795.858			-
				Durasi (D)	1,0000		
				Dispersi	-		

### Lampiran 3 : Durasi dan Dispersi Saham

31/12/2006

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Saham DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2007	574.000.000,00	11,25%	515.955.056	5,70%	0,0570	3.368.945.501,6066
2	2008	1.015.000.000,00	11,25%	820.098.472	9,06%	0,1811	1.983.771.248,4268
3	2009	1.155.000.000,00	11,25%	838.845.396	9,26%	0,2779	258.660.167,7412
4	2010	10.539.250.000,00	11,25%	6.880.335.690	75,98%	3,0393	1.360.672.236,2741
				9.055.234.614			6.972.049.154
				Durasi Saham (D)	3,5553		
				Dispersi	0,7699		

31/12/2007

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Saham DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2008	1.015.000.000,00	11,25%	912.359.551	9,60%	0,0960	2.666.861.870,7948
2	2009	1.155.000.000,00	11,25%	933.215.503	9,82%	0,1965	470.022.588,5324
3	2010	10.539.250.000,00	11,25%	7.654.373.455	80,57%	2,4172	645.111.929,3517
				9.499.948.508			3.781.996.389
				Durasi Saham (D)	2,7097		
				Dispersi	0,3981		

31/12/2008

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Saham DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2009	1.155.000.000,00	11,25%	1.038.202.247	10,87%	0,1087	824.819.199,96
2	2010	10.539.250.000,00	11,25%	8.515.490.468	89,13%	1,7827	100.561.341,72
				9.553.692.716			925.380.542
				Durasi Saham (D)	1,8913		
				Dispersi	0,0969		

31/12/2009

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Saham DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2010	10.539.250.000,00	11,25%	9.423.210.732	100,00%	1,0000	-
				9.423.210.732			-
				Durasi Saham (D)	1,0000		
				Dispersi	-		

## Lampiran 4 : Durasi dan Dispersi Penyertaan Langsung

31/12/2006

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Penyertaan DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2007	37.800.000,00	11,25%	33.977.528	11,03%	0,1103	171.082.403,9214
2	2008	55.200.000,00	11,25%	44.600.429	14,48%	0,2896	69.011.556,0476
3	2009	57.500.000,00	11,25%	41.760.702	13,56%	0,4067	2.484.573,2126
4	2010	287.500.000,00	11,25%	187.688.546	60,93%	2,4373	107.294.326,5246
				308.027.205			349.872.860
				Durasi (D)	3,2439		
				Dispersi	1,1359		

31/12/2007

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Penyertaan DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2008	55.200.000,00	11,25%	49.617.978	16,27%	0,1627	114.958.092,5491
2	2009	57.500.000,00	11,25%	46.458.780	15,24%	0,3048	12.665.325,4295
3	2010	287.500.000	11,25%	208.803.508	68,49%	2,0546	47.683.363,3145
				304.880.266			175.306.781
				Durasi Reksadana (D)	2,5221		
				Dispersi	0,5750		

31/12/2008

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Penyertaan DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2009	57.500.000	11,25%	51.685.393	18,20%	0,1820	34.583.591,2419
2	2010	287.500.000	11,25%	232.293.902	81,80%	1,6360	7.694.849,0513
				283.979.296			42.278.440
				Durasi Reksadana (D)	1,8180		
				Dispersi	0,1489		

31/12/2009

Proyeksi Imbal Hasil Portofolio Penyertaan DPPK ABC

t	Akhir Tahun	Imbal Hasil	Target Total Return	PV	Bobot	Bobot x t	$(t-D)^2 \times PV$
1	2010	230.000.000	11,25%	206.741.573	100%	1,0000	-
				206.741.573			-
				Durasi Reksadana (D)	1,0000		
				Dispersi	-		

## Lampiran 5 : Durasi dan Dispersi Obligasi

Rincian Portofolio Obligasi DPPK ABC  
per

31 Desember 2006

No	Nama Emiten	Nilai Nominal	Nilai Wajar	Duration	Dispersi	Bobot	Durasi x Bobot	Dispersi x Bobot
1	PT. Oto Multiartha III tahun 2004	1.000.000.000	990.000.000	0,214	-	0,9678%	0,0021	-
2	PT. Jasa Marga IX tahun 2002 seri N1	500.000.000	519.650.000	0,283	-	0,5080%	0,0014	-
3	PT. Astra Sedaya Finance III tahun 2003 seri C	500.000.000	498.500.000	0,377	0,001	0,4873%	0,0018	0,00
4	PT. Pupuk Kaltim I tahun 2002 seri A1	1.000.000.000	1.025.000.000	0,422	0,001	1,0020%	0,0042	0,00
5	PT. Wom Finance II A tahun 2005	1.000.000.000	1.000.000.000	0,434	0,001	0,9776%	0,0042	0,00
6	PT. Adhi Karya III tahun 2004	2.000.000.000	1.610.000.000	0,492	0,002	1,5739%	0,0077	0,00
7	PT. Telkom I tahun 2002	5.000.000.000	5.222.500.000	0,490	0,002	5,1053%	0,0250	0,00
8	PT. FIF II tahun 2003 seri D	600.000.000	590.400.000	0,492	0,002	0,5772%	0,0028	0,00
9	PT. Pembangunan Perumahan II Seri A tahun 2004	1.000.000.000	1.004.800.000	0,651	0,006	0,9823%	0,0064	0,00
10	PT. Matahari Putra Prima I tahun 2002	4.000.000.000	4.104.000.000	0,709	0,012	4,0119%	0,0285	0,00
11	PT. Indosat II tahun 2002 seri A	3.000.000.000	3.091.500.000	0,811	0,017	3,0221%	0,0245	0,00
12	PT. HM Sampoerna II tahun 2000	1.000.000.000	1.067.500.000	0,834	0,021	1,0436%	0,0087	0,00
13	PT. Berlina I tahun 2004 seri A	1.000.000.000	856.500.000	0,955	0,025	0,8373%	0,0080	0,00
14	PT. Astra Sedaya Finance IV tahun 2004 seri E	1.000.000.000	1.005.250.000	1,174	0,052	0,9827%	0,0115	0,00
15	PT. Wom Finance II B tahun 2005	1.000.000.000	981.150.000	1,334	0,083	0,9591%	0,0128	0,00
16	PT. CMNP III seri A tahun 2005	2.000.000.000	1.997.000.000	1,391	0,089	1,9522%	0,0272	0,00
17	PT. Indofood Sukses Makmur II tahun 2003	7.000.000.000	7.096.600.000	1,383	0,095	6,9374%	0,0959	0,01
18	PT. Indomobil F Indonesia II tahun 2005	1.000.000.000	997.000.000	1,384	0,094	0,9746%	0,0135	0,00
19	PT. Surya Citra Televisi I tahun 2003	3.000.000.000	2.973.000.000	1,381	0,097	2,9063%	0,0401	0,00
20	PT. Danareksa Inv. Management I tahun 2003	3.000.000.000	3.151.500.000	1,378	0,098	3,0808%	0,0425	0,00
21	PT. Swadharma Indotama III tahun 2003	2.000.000.000	1.529.200.000	1,362	0,110	1,4949%	0,0204	0,00
22	PT. Mayora Indah II tahun 2003	3.000.000.000	2.937.000.000	1,378	0,098	2,8711%	0,0396	0,00
23	PT. Swadharma Indotama IV-B tahun 2005	1.000.000.000	977.000.000	1,377	0,099	0,9551%	0,0132	0,00
24	Perum Pegadaian VII tahun 2000	2.000.000.000	1.947.000.000	1,361	0,110	1,9033%	0,0259	0,00
25	PT. Arpeni Pratama Ocean I tahun 2003	1.000.000.000	960.150.000	1,578	0,160	0,9386%	0,0148	0,00
26	PT. Bank Tabungan Negara IX tahun 2003	1.000.000.000	1.003.600.000	1,599	0,144	0,9811%	0,0157	0,00
27	PT. Indosat III tahun 2003 seri A	5.000.000.000	4.079.000.000	1,642	0,164	3,9875%	0,0655	0,01
28	PT. RCTI I tahun 2003	2.000.000.000	1.970.000.000	1,587	0,153	1,9258%	0,0306	0,00
29	PT. Waskita Karya I tahun 2003 seri B	1.000.000.000	1.000.000.000	1,689	0,200	0,9776%	0,0165	0,00
30	PT. Infoasia Teknologi I tahun 2004 seri B	1.000.000.000	1.000.000.000	1,789	0,225	0,9776%	0,0175	0,00
31	PT. Perkebunan N VII tahun 2004 seri A	1.000.000.000	1.021.000.000	1,964	0,322	0,9981%	0,0196	0,00
32	PT. FIF VI tahun 2006 seri C	2.000.000.000	2.037.500.000	1,956	0,340	1,9918%	0,0390	0,01
33	PT. Matahari Putra Prima II tahun 2004	4.000.000.000	4.152.800.000	1,976	0,555	4,0596%	0,0802	0,02
34	PT. Matahari PP Syariah Ijarah I tahun 2004	1.000.000.000	979.500.000	2,052	0,374	0,9575%	0,0196	0,00
35	PT. Bank Tabungan Negara X tahun 2004	1.000.000.000	1.045.500.000	2,194	0,401	1,0220%	0,0224	0,00
36	PT. Astra Sedaya Finance VII tahun 2006 seri E	1.000.000.000	1.000.000.000	2,150	0,446	0,9776%	0,0210	0,00
37	PT. Kalbe Farma I tahun 2006	1.000.000.000	1.017.000.000	2,154	0,430	0,9942%	0,0214	0,00
38	PT. Citra Sari Makmur I tahun 2004	3.000.000.000	2.893.500.000	2,144	0,452	2,8286%	0,0606	0,01
39	PT. Medco Energi International I tahun 2004	5.000.000.000	5.200.000.000	2,173	0,423	5,0833%	0,1105	0,02
40	PT. Indofood Sukses Makmur III tahun 2004	1.000.000.000	987.100.000	2,185	0,412	0,9650%	0,0211	0,00
41	PT. Bank Jabar IV tahun 2004 seri B	4.000.000.000	3.140.000.000	2,351	0,562	3,0696%	0,0722	0,02
42	PT. Apexindo I seri A tahun 2005	1.000.000.000	1.040.500.000	2,733	1,189	1,0172%	0,0278	0,01
43	PT. PAM Lyonnaise IC tahun 2005	1.000.000.000	1.020.000.000	2,854	1,087	0,9971%	0,0285	0,01
44	PT. Indosat III tahun 2003 seri B	5.000.000.000	5.087.500.000	3,073	1,333	4,9734%	0,1528	0,07
45	PT. Jasa Marga X tahun 2002 seri O	2.000.000.000	2.270.000.000	3,053	1,655	2,2191%	0,0678	0,04
46	PT. Bank Negara Indonesia I tahun 2003	4.000.000.000	4.086.124.000	3,474	2,072	3,9945%	0,1388	0,08
47	PT. Jasa Marga XI tahun 2003 seri P	1.000.000.000	1.032.933.000	4,702	5,404	1,0098%	0,0475	0,05
48	PT. BRI tahun 2004 Subordinasi I	2.500.000.000	2.600.000.000	4,664	5,983	2,5417%	0,1186	0,15
49	PT. Tjiwi Kimia I tahun 1996 A	201.141.822	127.825.628	5,050	7,676	0,1250%	0,0063	0,01
50	Perum Pegadaian XI tahun 2006 seri A	1.000.000.000	1.005.200.000	5,490	11,284	0,9826%	0,0540	0,11
51	PT. PLN VIII tahun 2006 seri A	1.000.000.000	1.052.923.000	5,538	11,271	1,0293%	0,0570	0,12
52	PT. PLN Syariah Ijarah I tahun 2006	1.000.000.000	1.000.000.000	5,463	11,290	0,9776%	0,0534	0,11
53	PT. Jasa Marga XII tahun 2006 seri Q	1.000.000.000	1.038.227.000	5,543	11,330	1,0149%	0,0563	0,11
54	PT. Tjiwi Kimia I tahun 1996 B	275.000.000	275.000.000	6,677	14,614	0,2688%	0,0179	0,04
			102.294.932.628,00	1,943	1,063	1	1,9427	1,0629

Durasi Portofolio Obligasi DPPK ABC

1,943

Dispersi Portofolio Obligasi DPPK ABC

1,063

(Lanjutan)

Rincian Portofolio Obligasi DPPK ABC  
per 31 Desember 2007

No	Nama Emiten	Nilai Nominal	Nilai Wajar	Duration	Dispersi	Bobot	Durasi x Bobot	Dispersi x Bobot
1	PT. Tjiwi Kimia I tahun 1996 A	161.391.507	92.041.576	4,575	5,717	0,0978%	0,0045	0,0056
2	PT. Tjiwi Kimia I tahun 1996 B	275.000.000	211.750.000	5,958	12,244	0,2250%	0,0134	0,0276
3	Perum Pegadaian VII tahun 2000	2.000.000.000	1.994.000.000	0,491	0,002	2,1191%	0,0104	0,0000
4	PT. Jasa Marga X tahun 2002 seri O	2.000.000.000	2.348.000.000	2,454	0,781	2,4954%	0,0612	0,0195
5	PT. Indofood Sukses Makmur II tahun 2003	7.000.000.000	7.240.100.000	0,434	0,001	7,6945%	0,0334	0,0001
6	PT. Surya Citra Televisi I tahun 2003	3.000.000.000	3.042.600.000	0,482	0,002	3,2335%	0,0156	0,0001
7	PT. Swadharma Indotama III tahun 2003	2.000.000.000	2.030.000.000	0,491	0,002	2,1574%	0,0106	0,0000
8	PT. Danareksa Inv. Management I tahun 2003	3.000.000.000	3.129.000.000	0,482	0,002	3,3254%	0,0160	0,0001
9	PT. Mayora Indah II tahun 2003	3.000.000.000	3.090.000.000	0,492	0,002	3,2839%	0,0161	0,0001
10	PT. Swadharma Indotama IV-B tahun 2005	1.000.000.000	1.041.300.000	0,491	0,002	1,1066%	0,0054	0,0000
11	PT. RCTI I tahun 2003	1.142.857.143	1.190.857.143	0,726	0,010	1,2656%	0,0092	0,0001
12	PT. Indosat III tahun 2003 seri A	5.000.000.000	5.100.000.000	0,782	0,012	5,4201%	0,0424	0,0006
13	PT. Indosat III tahun 2003 seri B	5.000.000.000	5.265.000.000	2,379	0,605	5,5954%	0,1331	0,0338
14	PT. Jasa Marga XI tahun 2003 seri P	1.000.000.000	985.000.000	4,198	3,729	1,0468%	0,0439	0,0390
15	PT. Bank Tabungan Negara IX tahun 2003	1.000.000.000	1.028.500.000	0,728	0,009	1,0930%	0,0080	0,0001
16	PT. Waskita Karya I tahun 2003 seri B	1.000.000.000	1.047.000.000	0,851	0,018	1,1127%	0,0095	0,0002
17	PT. BRI tahun 2004 Subordinasi I	2.500.000.000	2.695.000.000	4,245	4,186	2,8641%	0,1216	0,1199
18	PT. Astra Sedaya Finance IV tahun 2004 seri E	250.000.000	258.525.000	0,230	-	0,2747%	0,0006	-
19	PT. Perkebunan N VII tahun 2004 seri A	1.000.000.000	1.046.000.000	1,161	0,053	1,1116%	0,0129	0,0006
20	PT. Matahari PP Syariah Ijarah I tahun 2004	1.000.000.000	979.500.000	1,262	0,071	1,0410%	0,0131	0,0007
21	PT. Matahari Putra Prima II tahun 2004	4.000.000.000	4.204.000.000	1,263	0,076	4,4678%	0,0564	0,0034
22	PT. Bank Tabungan Negara X tahun 2004	1.000.000.000	1.041.000.000	1,308	0,070	1,1063%	0,0145	0,0008
23	PT. Citra Sari Makmur I tahun 2004	3.000.000.000	3.055.500.000	1,377	0,099	3,2473%	0,0447	0,0032
24	PT. Medco Energi Internasional I tahun 2004	5.000.000.000	5.071.000.000	1,386	0,093	5,3892%	0,0747	0,0050
25	PT. Bank Jabar IV tahun 2004 seri B	4.000.000.000	4.056.800.000	1,599	0,143	4,3114%	0,0689	0,0062
26	PT. Infoasia Teknologi I tahun 2004 seri B	1.000.000.000	999.100.000	0,953	0,026	1,0618%	0,0101	0,0003
27	PT. CMNP III seri A tahun 2005	2.000.000.000	1.997.000.000	0,434	0,001	2,1223%	0,0092	0,0000
28	PT. Indomobil F Indonesia II tahun 2005	1.000.000.000	1.034.200.000	0,453	0,001	1,0991%	0,0050	0,0000
29	PT. Bank Negara Indonesia I tahun 2003	4.000.000.000	4.368.000.000	2,873	1,063	4,6421%	0,1334	0,0493
30	PT. Arpeni Pratama Ocean I tahun 2003	1.000.000.000	1.005.600.000	0,725	0,010	1,0687%	0,0077	0,0001
31	PT. Indofood Sukses Makmur III tahun 2004	1.000.000.000	1.050.500.000	1,391	0,089	1,1164%	0,0155	0,0010
32	PT. FIF VI tahun 2006 seri C	2.000.000.000	1.689.000.000	1,163	0,059	1,7950%	0,0209	0,0011
33	Perum Pegadaian XI tahun 2006 seri A	1.000.000.000	1.156.200.000	5,359	8,733	1,2288%	0,0659	0,1073
34	PT. Astra Sedaya Finance VII tahun 2006 seri E	1.000.000.000	1.000.000.000	1,336	0,089	1,0628%	0,0142	0,0009
35	PT. Kalbe Farma I tahun 2006	1.000.000.000	1.053.500.000	1,374	0,093	1,1196%	0,0154	0,0010
36	PT. PLN Syariah Ijarah I tahun 2006	1.000.000.000	1.000.000.000	5,157	9,049	1,0628%	0,0548	0,0962
37	PT. PLN VIII tahun 2006 seri A	1.000.000.000	1.185.000.000	5,342	8,913	1,2594%	0,0673	0,1123
38	PT. Jasa Marga XII tahun 2006 seri Q	1.000.000.000	1.160.000.000	5,343	8,973	1,2328%	0,0659	0,1106
39	PT. Apexindo I seri A tahun 2005	1.000.000.000	1.028.000.000	2,001	0,297	1,0925%	0,0219	0,0032
40	PT. PAM Lyonnaise IC tahun 2005	1.000.000.000	1.015.600.000	2,167	0,430	1,0793%	0,0234	0,0046
41	PT. Wom Finance III B tahun 2006	1.000.000.000	1.078.000.000	2,132	0,463	1,1457%	0,0244	0,0053
42	PT EXCELCOMINDO II Tahun 2007	1.000.000.000	1.009.000.000	3,493	1,578	1,0723%	0,0375	0,0169
43	PT. Indofood Sukses Makmur IV tahun 2007	1.000.000.000	1.000.000.000	3,513	1,550	1,0628%	0,0373	0,0165
44	PT. Wom Finance IV C tahun 2007	1.000.000.000	1.023.500.000	2,911	1,019	1,0877%	0,0317	0,0111
45	PT. Wom Finance IV B tahun 2007	1.000.000.000	1.000.300.000	2,836	1,003	1,0631%	0,0301	0,0107
46	PT RADIANT UTAMA INTERINSCO I Tahun 2007	1.000.000.000	1.000.000.000	3,575	1,949	1,0628%	0,0380	0,0207
47	PT BFI FINANCE INDONESIA Tahun 2007	2.000.000.000	2.000.000.000	1,499	0,115	2,1255%	0,0319	0,0025
48	PT BAKRIE TELEKOM I Tahun 2007	2.000.000.000	2.000.000.000	3,744	2,085	2,1255%	0,0796	0,0443
49	PT BANK LAMPUNG	2.000.000.000	2.000.000.000	3,699	2,275	2,1255%	0,0786	0,0484
			94.094.973.719	1,760	0,931	100,0000%	1,7598	0,9311

## Lampiran 6 : Durasi dan Dispersi SUN

Rincian Portofolio Obligasi DPPK ABC  
per **31 Desember 2007**

No	Nama Emiten	Nilai Nominal	Nilai Wajar	Duration	Dispersi	Bobot	Durasi x Bobot	Dispersi x Bobot
1	Obligasi Negara Th 2006 Seri FR0040	2.000.000.000	2.153.400.000	8,403	34,913	21,13%	1,7753	7,3761
2	Obligasi Negara Th 2006 Seri FR0038	2.000.000.000	2.193.200.000	6,498	13,471	21,52%	1,3982	2,8986
3	Obligasi Negara Th 2006 Seri FR0034	2.000.000.000	2.344.000.000	7,218	21,694	23,00%	1,6600	4,9890
4	Obligasi Negara Th 2006 Seri FR0035	1.000.000.000	1.230.000.000	7,575	24,683	12,07%	0,9141	2,9787
5	Obligasi Negara Th 2006 Seri FR0039	2.000.000.000	2.272.000.000	7,911	28,185	22,29%	1,7635	6,2826
			10.192.600.000				7,5110	24,5248



## Lampiran 7 : Contoh Perhitungan Durasi dan Dispersi Obligasi

### 1 Perum Pegadaian XI tahun 2006 seri A

tgl settlement	31/12/2006
tgl maturity	23/05/2016
kupon triwulanan	13,1000%
value	1.000.000.000
yield	13,0322%
time to maturity	9,40 tahun

	term kupon	kupon	DCF	PV	w	w x t	
1	0,25	32.750.000	0,9684	31.716.653,02	3,22%	0,0081	871.021.163,58
2	0,50	32.750.000	0,9379	30.715.910,80	3,12%	0,0156	764.974.957,50
3	0,75	32.750.000	0,9083	29.746.744,58	3,02%	0,0227	668.471.998,79
4	1,00	32.750.000	0,8796	28.808.158,05	2,93%	0,0293	580.898.311,91
5	1,25	32.750.000	0,8519	27.899.186,35	2,83%	0,0354	501.672.867,25
6	1,50	32.750.000	0,8250	27.018.895,05	2,74%	0,0412	430.245.996,59
7	1,75	32.750.000	0,7990	26.166.379,22	2,66%	0,0465	366.097.879,29
8	2,00	32.750.000	0,7738	25.340.762,45	2,57%	0,0515	308.737.096,47
9	2,25	32.750.000	0,7493	24.541.196,03	2,49%	0,0561	257.699.250,15
10	2,50	32.750.000	0,7257	23.766.857,99	2,41%	0,0603	212.545.644,56
11	2,75	32.750.000	0,7028	23.016.952,31	2,34%	0,0643	172.862.027,05
12	3,00	32.750.000	0,6806	22.290.708,09	2,26%	0,0679	138.257.385,99
13	3,25	32.750.000	0,6592	21.587.378,75	2,19%	0,0712	108.362.803,23
14	3,50	32.750.000	0,6384	20.906.241,26	2,12%	0,0743	82.830.358,77
15	3,75	32.750.000	0,6182	20.246.595,42	2,06%	0,0771	61.332.085,48
16	4,00	32.750.000	0,5987	19.607.763,11	1,99%	0,0797	43.558.971,49
17	4,25	32.750.000	0,5798	18.989.087,60	1,93%	0,0820	29.220.008,56
18	4,50	32.750.000	0,5615	18.389.932,90	1,87%	0,0840	18.041.283,97
19	4,75	32.750.000	0,5438	17.809.683,08	1,81%	0,0859	9.765.114,54
20	5,00	32.750.000	0,5266	17.247.741,64	1,75%	0,0876	4.149.220,52
21	5,25	32.750.000	0,5100	16.703.530,90	1,70%	0,0891	965.937,95
22	5,50	32.750.000	0,4939	16.176.491,41	1,64%	0,0904	1.467,53
23	5,75	32.750.000	0,4784	15.666.081,37	1,59%	0,0915	1.055.158,69
24	6,00	32.750.000	0,4633	15.171.776,09	1,54%	0,0924	3.938.827,05
25	6,25	32.750.000	0,4486	14.693.067,42	1,49%	0,0933	8.476.104,02
26	6,50	32.750.000	0,4345	14.229.463,24	1,45%	0,0939	14.501.816,94
27	6,75	32.750.000	0,4208	13.780.486,97	1,40%	0,0945	21.861.398,64
28	7,00	32.750.000	0,4075	13.345.677,06	1,36%	0,0949	30.410.324,90
29	7,25	32.750.000	0,3946	12.924.586,52	1,31%	0,0952	40.013.578,67
30	7,50	32.750.000	0,3822	12.516.782,48	1,27%	0,0953	50.545.139,92
31	7,75	32.750.000	0,3701	12.121.845,70	1,23%	0,0954	61.887.499,92
32	8,00	32.750.000	0,3585	11.739.370,20	1,19%	0,0954	73.931.198,76
33	8,25	32.750.000	0,3471	11.368.962,79	1,15%	0,0953	86.574.385,38
34	8,50	32.750.000	0,3362	11.010.242,68	1,12%	0,0950	99.722.398,69
35	8,75	32.750.000	0,3256	10.662.841,12	1,08%	0,0948	113.287.369,21
36	9,00	32.750.000	0,3153	10.326.400,98	1,05%	0,0944	127.187.840,08
37	9,25	32.750.000	0,3054	10.000.576,39	1,02%	0,0939	141.348.406,60
40	9,50	1.032.750.000	0,2774	286.442.246,43	29,09%	2,7635	4.604.928.145,57
				984.693.257,45			11.111.381.424,19

5,4905	Duration
4,8574	Modified Duration
11,2841	Dispersi



(Lanjutan)

2 PT. Adhi Karya III tahun 2004

tgl settlement 31/12/2006  
tgl maturity 13/07/2007  
kupon triwulanan 13,2500%  
value 2.000.000.000  
yield 16,4596%  
time to maturity 0,54 tahun

	term kupon	kupon	DCF	PV	w	w x t	
1	0,25	66.250.000	0,9605	63.631.618,20	3,23%	0,0081	3.724.182,62
2	0,50	2.066.250.000	0,9225	1.906.149.839,76	96,77%	0,4838	124.321,69
				1.969.781.457,96			3.848.504,31

0,4919	Duration
0,4224	Modified Duration
0,0020	Dispersi

3 PT. Astra Sedaya Finance III tahun 2003 seri C

tgl settlement 31/12/2006  
tgl maturity 20/05/2007  
kupon triwulanan 13,5000%  
value 500.000.000  
yield 13,5406%  
time to maturity 0,39 tahun

	term kupon	kupon	DCF	PV	w	w x t	
1	0,25	16.875.000	0,9673	16.322.459,37	3,27%	0,0082	264.369,00
2	0,39	516.875.000	0,9356	483.580.919,35	96,73%	0,3773	78.414,69
				499.903.378,73			264.369,00

0,3773	Duration
0,3323	Modified Duration
0,0005	Dispersi