

Nusadana ETF – IDX Value 30

PT Nusadana Investama Indonesia

Gedung Office 8 lantai 32 SCBD Lot.28

Jl. Jend.Sudirman Kav.52 – 53, Jakarta Selatan 12190

Phone : (6221) 27933758 Fax : (6221) 2933 3509

E-mail : info@nusadana.com



Definisi & Payung Hukum ETF

- **ETF (*Exchange Traded Funds*)** adalah Reksa Dana berbentuk Kontrak Investasi Kolektif (KIK) yang Unit Penyertaannya diperdagangkan di Bursa seperti layaknya saham.
- Payung Hukum
 - POJK No 49/POJK.04/2015 tentang Reksa Dana berbentuk Kontrak Investasi Kolektif yang unit penyertaanya diperdagangkan di Bursa Efek
 - Keputusan Direksi PT Bursa Efek Jakarta Nomor : Kep-310/BEJ/12-2006 Tentang Pencatatan dan Perdagangan unit penyertaan Reksa Dana berbentuk Kontrak Investasi Kolektif di Bursa.
- Insentif
 - * Peraturan BEI tentang penghapusan pajak final (0.01%) dan biaya transaksi (*Levy fee*) ETF saat ini masih dalam proses pengesahan dan rencananya akan mulai berlaku per 1 September 2019.



Product ETF Equity di IDX

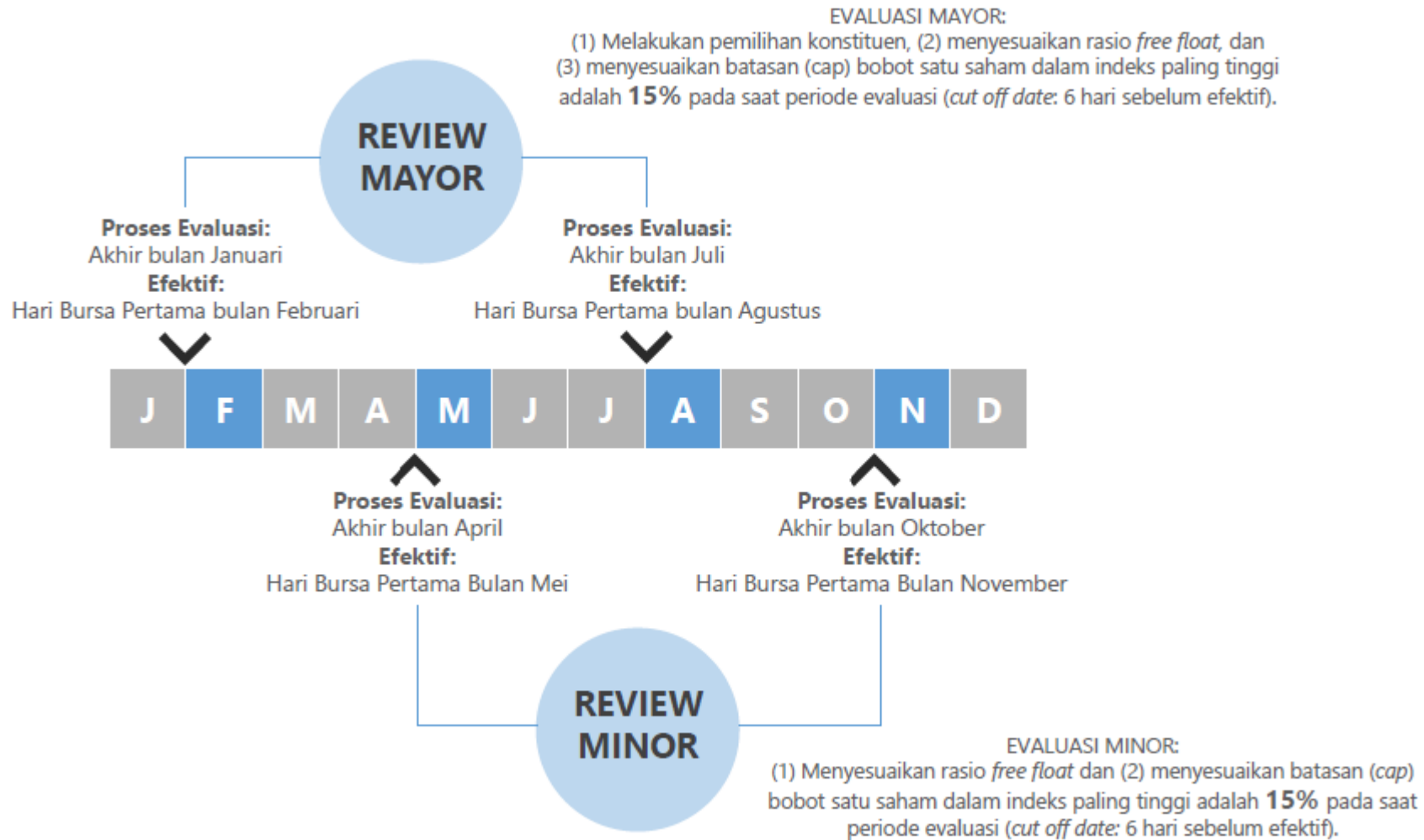
No	Ticker Code	ETF	Tanggal Pencatatan	Unit Penyertaan*	Price 11 June 2019	AUM
1	XIPI	Reksa Dana Premier ETF PEFINDO i-Grade	21-Des-18	115,000,000	170	19,550,000,000
2	XIHD	Reksa Dana Indeks Premier ETF High Dividen 20	18-Des-18	89,600,000	520	46,592,000,000
3	XSBC	Reksa Dana Indeks Simas ETF IDX30	12-Sep-18	4,171,900,000	112	467,252,800,000
4	XPFT	Reksa Dana Indeks Pinnacle FTSE Indonesia ETF	10-Sep-18	295,000,000	526	155,170,000,000
5	XMTS	Reksa Dana ETF MNC36 LIKUID	29-Agu-18	16,500,000	531	8,761,500,000
6	XPID	Reksa Dana Indeks Pinnacle IDX30 ETF	28-Mei-18	331,400,000	497	164,705,800,000
7	XBNI	Reksa Dana Indeks BNI-AM Nusantara ETF MSCI Indonesia	23-Mei-18	595,900,000	1,053	627,482,700,000
8	XDIF	Reksa Dana Danareksa ETF Indonesia Top 40	23-Apr-18	809,100,000	470	380,277,000,000
9	XBLQ	Reksa Dana Batavia Smart Liquid ETF	10-Apr-18	882,500,000	500	441,250,000,000
10	XPSG	Reksa Dana Pinnacle Indonesia ESG ETF	02-Feb-18	33,000,000	419	13,827,000,000
11	XPES	Reksa Dana Syariah KIK Pinnacle Enhanced Sharia ETF	12-Okt-17	41,500,000	406	16,849,000,000
12	XPLC	Reksa Dana Pinnacle Indonesia Large-Cap ETF	14-Jun-17	73,800,000	482	35,571,600,000
13	XPDV	Reksa Dana Pinnacle Core High Dividend ETF	09-Jun-17	5,300,000	505	2,676,500,000
14	XISB	Reksa Dana Premier ETF Indonesia Sovereign Bonds	02-Feb-17	2,505,700,000	398	997,268,600,000

No	Ticker Code	Nama Perusahaan	Tanggal Pencatatan	Unit Penyertaan*	Price 11 June 2019	AUM
15	XPLQ	Reksa Dana Pinnacle Enhanced Liquid ETF	15-Agu-16	163,100,000	507	82,691,700,000
16	XISC	Reksa Dana Premier ETF Indonesia State-Owned	01-Okt-15	1,248,800,000	720	899,136,000,000
17	XIIF	Reksa Dana Premier ETF Indonesia Financial	19-Nov-14	162,000,000	711	115,182,000,000
18	XISR	Reksa Dana Premier ETF SRI-KEHATI	26-Sep-14	1,185,900,000	408	483,847,200,000
19	XISI	Reksa Dana Premier ETF SMinfra18	06-Mar-14	206,200,000	349	71,963,800,000
20	XIIC	Reksa Dana Premier ETF Indonesia Consumer	30-Apr-13	48,600,000	1,117	54,286,200,000
21	XIJI	Reksa Dana Syariah Premier ETF JII	30-Apr-13	34,700,000	669	23,214,300,000
22	XIIT	Reksa Dana Premier ETF IDX30	30-Okt-12	4,415,800,000	570	2,517,006,000,000
23	XBID	Reksa Dana Batavia IDX30 ETF	19-Feb-19	800,000	546	436,800,000
24	R-LQ45X	Reksa Dana Premier ETF LQ-45	18-Des-07	1,953,000,000	1,052	2,054,556,000,000
25	XBSK	Reksa Dana Indeks Batavia SRI-KEHATI ETF	22-Mar-19	16,800,000	392	6,585,600,000
26	XPMI	Reksa Dana Indeks ETF Phillip MSCI Indonesia Equity Index	12-Apr-19	11,200,000	940	10,528,000,000
27	XPTD	Reksa Dana Indeks Panin ETF IDX30 Dinamis	27-Mei-19	10,000,000	511	5,110,000,000
					Total	9,701,778,100,000

IDX Value30 Index (IDXV30)

DESKRIPSI	Indeks yang mengukur performa harga dari 30 saham – saham dengan likuiditas transaksi serta kinerja keuangan yang baik yang dipilih berdasarkan nilai PBV dan PER yang rendah
METODE	<ul style="list-style-type: none">• <i>Free Float Adjusted Capped Market Capitalization Weighting</i>• Dengan Batasan (<i>cap</i>) bobot sebesar 15% pada tiap evaluasi
HARI DASAR	30 Januari 2014
NILAI DASAR	100

Jadwal Peninjauan Berkala



Bobot Konstituen Indeks IDX Value 30

IDX Value30 Index

No.	Kode	FF-MC (Milliar IDR)	Bobot (%)	No.	Kode	FF-MC (Milliar IDR)	Bobot (%)
1	BBNI	36.700	14,8%	16	BDMN	3.357	1,4%
2	INDF	33.779	13,6%	17	BMTR	3.120	1,3%
3	UNTR	30.909	12,5%	18	WSBP	3.062	1,2%
4	PGAS	20.032	8,1%	19	ASRI	2.785	1,1%
5	ADRO	16.762	6,8%	20	SRIL	2.758	1,1%
6	INKP	15.702	6,3%	21	TINS	2.631	1,1%
7	PTBA	9.557	3,9%	22	ADHI	2.478	1,0%
8	BBTN	9.352	3,8%	23	ERAA	2.449	1,0%
9	WSKT	8.505	3,4%	24	INDY	2.269	0,9%
10	WIKA	7.365	3,0%	25	BNGA	1.969	0,8%
11	BJBR	6.393	2,6%	26	ESSA	1.520	0,6%
12	PTPP	6.000	2,4%	27	WTON	1.356	0,5%
13	PNBN	5.406	2,2%	28	ELSA	1.115	0,4%
14	ITMG	5.091	2,1%	29	MAIN	894	0,4%
15	PNLF	3.888	1,6%	30	HRUM	692	0,3%

Sektor	#Stocks	Bobot
Mining	7	27%
Finance	7	27%
Miscellaneous Industry	4	21%
Property, Real Estate and B.Construction	7	13%
Infrastructure, Utilities and Transportation	2	9%
Trade, Service & Investment	2	2%
Basic Industry and Chemicals	1	1%
Agriculture	0	0%

Why IDXV30 ??

Why IDXV30 ?

- Indeks dengan tema “value” sudah sangat familier di bursa luar negeri.
- Memberikan pilihan kepada investor sebuah acuan atau basis investasi secara sederhana/tidak perlu melakukan screening (likuiditas, fundamental, dan PER rendah).

Contoh Indeks Value yang terdapat di bursa-bursa utama dunia :

Providers	Indeks
Stock Exchange	
ASX	S&P/ASX 200 Value
JPX	TOPIX Value Family
Shanghai SE	SSE Value Index Family
Index Providers	
S&P	S&P Value Index Vamily
MSCI	MSCI Value Index

Why IDXV30 ?

Proses Seleksi IDXV30

Semesta

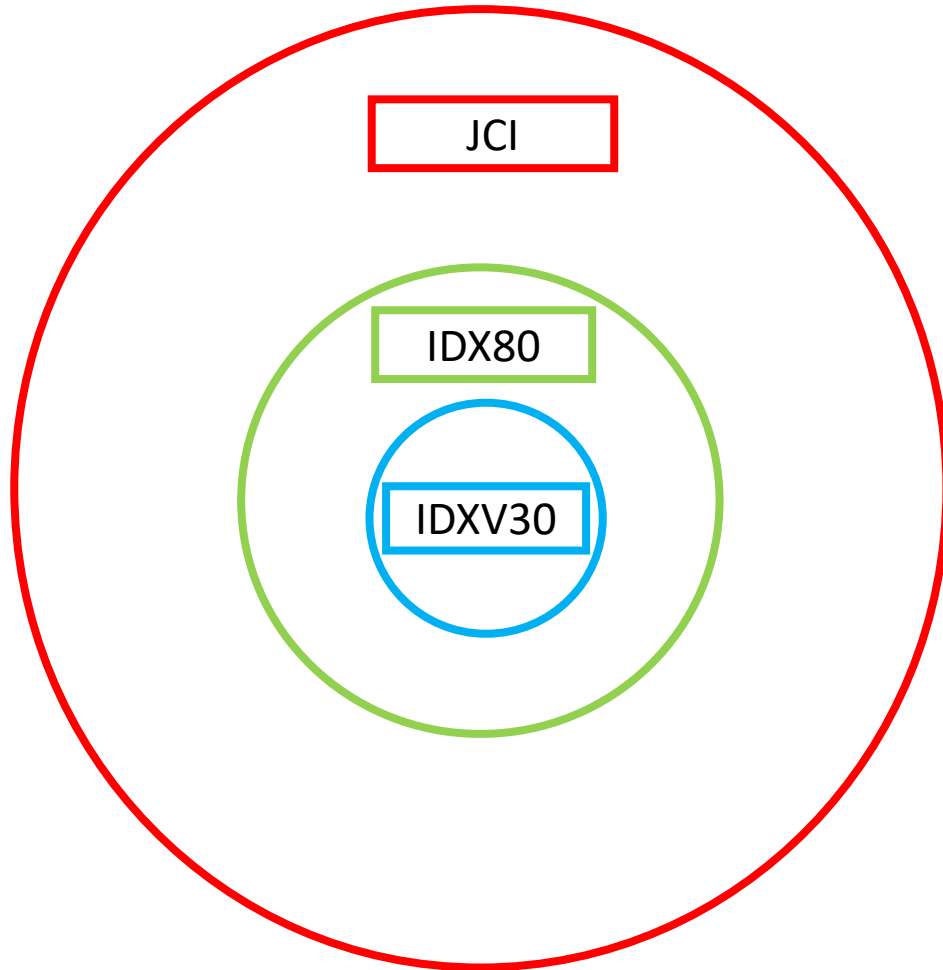
Saham – saham konstituen Indeks IDX80

Seleksi

- Mengeluarkan saham-saham yang: mengalami kerugian, memiliki ekuitas negatif, memiliki PER > 200. dan memiliki PBV > 100
- Penghitungan PBV dan PER masing-masing saham mengacu pada Laporan Keuangan terakhir yang diterbitkan oleh perusahaan tercatat

Pemilihan

30 saham dengan nilai rasio P/BV & P/E paling rendah.

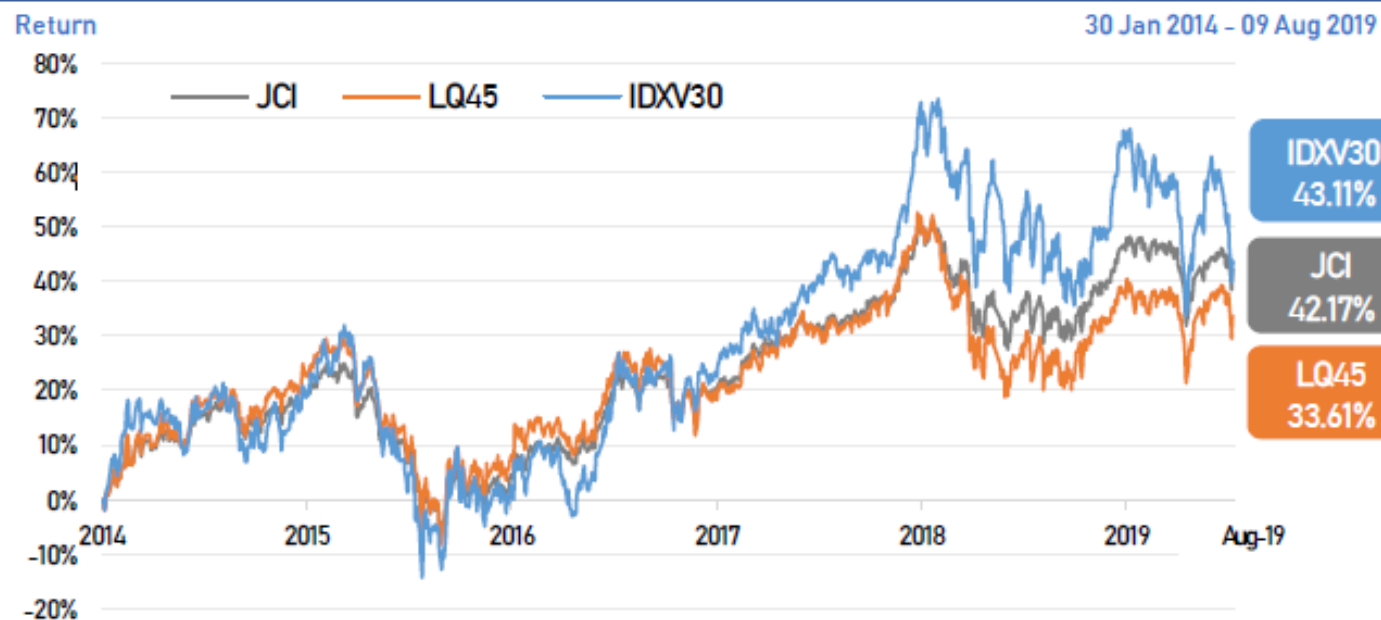


Why IDXV30 ?

Hasil Backtesting Kinerja Indeks IDX Value 30

IDX V30 vs JCI vs IDX45

HISTORICAL PERFORMANCE



INDEX PERFORMANCE

	Returns	YoY Returns			
		Year*	IDXV30	JCI	LQ45
6M	-10.13%				
1Y	-5.92%	2014	13.1%	18.3%	21.1%
3Y	17.06%	2015	-9.9%	-12.1%	-11.9%
5Y	20.72%	2016	21.0%	15.3%	11.7%
10Y	43.11%	2017	24.8%	20.0%	22.0%
Since Base Date	43.11%	2018	-3.2%	-2.5%	-9.0%
3Y (Ann.)	5.39%	YTD 2019	-3.9%	1.4%	0.8%
5Y (Ann.)	3.84%	*from 30 Jan 2014 to 09 Aug 2019 use backtesting data			
10Y (Ann.)	7.43%				
Since Base Date (Ann.)	7.43%				

*Thank
you*



DISCLAIMER

Dokumen ini disajikan oleh PT. Nusadana Investama Indonesia dan dibuat untuk memberikan informasi dan referensi atas produk keuangan dalam yuridiksi dimana Instrumen Keuangan tersebut dibentuk. Tidak ada jaminan, tersurat maupun tersirat, atas keakuratan atau lainnya mengenai proyeksi dan ilustrasi hasil dalam produk tersebut, jika ada. Sebelum melakukan pembelian calon investor wajib memahami risiko berinvestasi di Pasar Modal, memeriksa dan memahami kontrak perjanjian dan materi penawaran lainnya. Nilai investasi dalam produk investasi ini dapat menurun atau meningkat sesuai portfolio produk dan kondisi ekonomi keseluruhan. Tidak terdapat jaminan bahwa investasi tertentu cocok, sesuai atau menguntungkan bagi investor atau calon investor. © PT Nusadana Investama Indonesia 2019.