

LAMPIRAN

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.





Lampiran 1: Data Return Saham Yearly Perusahaan (%)

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	153.13	-37.65	90.10	4.17	-31.25
AISA	116.67	-36.54	118.18	32.41	46.50
DLTA	93.55	-7.08	128.70	49.02	2.63
DVLA	15.69	-1.71	46.96	30.18	-14.09
GGRM	85.61	55.13	-9.27	-25.40	44.52
HMSP	170.67	38.54	53.59	4.17	10.02
ICBP	33.57	11.23	27.17	30.77	28.43
INAF	-3.61	103.75	102.45	-53.64	132.03
INDF	37.32	-5.64	27.17	12.82	2.27
KAEF	25.20	113.84	117.65	-20.27	148.31
KLBF	150	4.62	-68.82	17.92	46.40
MBTO	53.70	2.60	-7.32	-19.74	-34.43
MERK	20.63	37.31	14.72	24.34	-15.34
MRAT	64.56	-23.08	-2.00	-5.10	-24.73
MYOR	138.89	32.56	40.35	30	-19.62
PSDN	-27.27	287.50	-33.87	-26.83	-4.67
PTSP	10.71	122.58	255.07	63.27	42.50
PYFA	15.45	38.58	0.57	-16.95	-8.16
RMBA	23.08	-1.25	-26.58	-1.72	-8.77
SKLT	-6.67	0.00	28.57	0.00	66.67
SMAR	96.08	28.00	2.34	19.85	3.18
SQBI	0	1114.29	86.67	27.73	97.53
STTP	54.00	79.22	52.17	47.62	85.81
TBLA	20.59	43.90	-16.95	-4.08	60.64
TCID	-11.11	6.94	42.86	8.18	47.27
TSPC	134.25	49.12	46.08	-12.75	-11.85
ULTJ	108.62	-10.74	23.15	238.35	-17.33
UNVR	49.32	13.94	10.90	24.70	0

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 2: Data Return Saham Window Period Perusahaan (%)

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	-1.8182	1.5823	-5.6058	-1.4481	0.2427
AISA	-0.8885	15.3846	-0.5277	3.5885	2.9042
DLTA	7.6389	0.8363	-2.4655	3.3816	1.1499
DVLA	2.4465	0	-2.1978	0.3244	7.0707
GGRM	0.4932	8.3179	4.4363	7.0723	5.1917
HMSP	0.7034	0.0947	2.3226	0.4111	1.2540
ICBP	-1.5480	3.2051	-3.8391	-7.3620	-1.7917
INAF	0	2.4793	-4.1237	0.6012	-4.1667
INDF	-1.1869	-1.5306	-1.1287	-3.0647	0.2250
KAEF	2.6923	0.7547	-1.2539	-1.9912	-2.6190
KLBF	5.9621	2.8504	0	1.8244	2.0985
MBTO	0	0.8097	1.7921	-0.5537	-1.3072
MERK	1.0050	3.5714	0.4405	1.8676	-1.0239
MRAT	2.9940	1.6667	4.5198	-0.0688	2.2962
MYOR	-2.1492	8.9187	0.3325	-0.1939	0.1155
PSDN	0	0	23.3333	2.7027	0
PTSP	11.7117	1.0989	17.9487	0	3.0588
PYFA	-0.2320	0.7207	-6.7742	-2.8634	-0.5181
RMBA	-2.3346	0.3690	-4.3011	4.2208	-2.6627
SKLT	0	0	0	0	0
SMAR	0.3125	3.5813	0	1.9512	2.9101
SQBI	0	-3.9409	19.5556	0	-1.0526
STTP	0	3.9106	0	-0.1333	0.2740
TBLA	13.5338	1.6043	0	3.9074	-2.0202
TCID	-0.4184	-1.3566	4.0698	-12.0833	-0.2653
TSPC	12.4754	-3.4591	-6.1269	-3.5263	-1.0823
ULTJ	-2.3202	-0.5731	1.8476	1.9516	2.5235
UNVR	0.2188	2.3993	0.8856	2.9820	0.7374

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 3: Data Current Ratio Perusahaan

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	1.51	1.71	1.94	1.81	1.54
AISA	1.29	1.89	1.28	1.75	2.66
DLTA	6.33	6.01	5.26	4.71	4.47
DVLA	3.72	4.83	4.31	4.24	5.18
GGRM	2.70	2.24	2.17	1.72	1.62
HMSP	1.61	1.75	1.78	1.75	1.53
ICBP	2.60	2.87	2.00	2.41	2.18
INAF	1.55	1.54	2.10	1.27	1.30
INDF	2.04	1.91	2.00	1.67	1.81
KAEF	2.43	2.75	2.80	2.43	2.39
KLBF	4.39	3.65	3.41	2.84	3.40
MBTO	1.59	4.08	3.71	3.99	3.95
MERK	6.23	7.52	3.87	3.98	4.59
MRAT	7.61	6.27	6.02	6.05	3.61
MYOR	2.58	2.22	2.76	2.44	2.09
PSDN	1.38	1.55	1.61	1.68	1.46
PTSP	1.24	1.66	1.47	1.86	1.49
PYFA	3.01	2.54	2.41	1.54	1.63
RMBA	2.50	1.12	1.64	1.18	1.00
SKLT	1.93	1.70	1.41	1.23	1.18
SMAR	1.53	1.86	2.10	1.05	1.08
SQBI	5.69	5.80	4.85	4.97	4.37
STTP	1.71	1.03	1.00	1.14	1.48
TBLA	1.11	1.38	1.59	1.12	1.10
TCID	10.68	11.74	3.55	3.57	1.80
TSPC	3.37	3.08	3.09	2.96	3.00
ULTJ	2.00	1.52	2.02	2.47	3.34
UNVR	0.85	0.69	0.67	0.70	0.92

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 4: Data Debt to Equity Perusahaan

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	2.25	0.60	0.86	0.67	0.71
AISA	2.34	0.96	0.90	1.13	1.05
DLTA	0.20	0.21	0.25	0.28	0.30
DVLA	0.33	0.28	0.28	0.30	0.28
GGRM	0.44	0.59	0.56	0.73	0.75
HMSP	1.01	0.90	0.97	0.94	1.10
ICBP	0.45	0.42	0.74	0.60	0.66
INAF	1.36	0.83	0.83	1.19	1.11
INDF	1.34	0.70	0.74	1.04	1.08
KAEF	0.49	0.43	0.44	0.52	0.65
KLBF	0.23	0.27	0.28	0.33	0.27
MBTO	1.85	0.35	0.40	0.36	0.37
MERK	0.20	0.18	0.37	0.36	0.29
MRAT	0.14	0.18	0.18	0.16	0.30
MYOR	1.18	1.72	1.71	1.47	1.51
PSDN	1.60	1.04	0.67	0.63	0.64
PTSP	1.86	0.90	0.72	0.60	0.82
PYFA	0.30	0.43	0.55	0.86	0.79
RMBA	1.30	1.82	2.60	9.47	-8.34
SKLT	0.69	0.74	0.93	1.16	1.16
SMAR	1.14	1.00	0.82	1.83	1.68
SQBI	0.19	0.20	0.22	0.21	0.25
STTP	0.45	0.91	1.16	1.12	1.08
TBLA	1.95	1.64	1.95	2.46	1.97
TCID	0.10	0.11	0.15	0.24	0.44
TSPC	0.36	0.40	0.38	0.40	0.35
ULTJ	0.54	0.65	0.44	0.40	0.29
UNVR	1.15	1.85	2.02	2.12	1.60

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 5: Data *Earning Per Share* Perusahaan (Rupiah)

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	53.67	43.85	141.34	94.33	52.59
AISA	45.53	65.22	110.34	150.82	145.91
DLTA	8715.76	9474.38	13327.83	16892.21	17989.74
DVLA	99.00	107.96	132.95	112.32	72.26
GGRM	2154.93	2576.86	2114.62	2278.45	2804.08
HMSP	1426.98	1789.12	2178.98	2401.77	2225.55
ICBP	292.24	353.98	554.84	392.16	432.58
INAF	4.05	11.93	13.68	-17.50	0.38
INDF	336.30	571.43	554.84	587.81	548.11
KAEF	24.98	30.93	37.05	38.83	42.59
KLBF	126.66	151.61	34.90	42.76	45.42
MBTO	34.36	39.87	43.32	15.66	2.78
MERK	5303.30	10319.60	4812.86	7832.37	8101.43
MRAT	57.05	60.25	80.43	-2.39	14.38
MYOR	631.48	631.15	969.02	1177.78	461.07
PSDN	8.97	16.57	17.79	14.81	-19.57
PTSP	71.41	135.66	220.22	169.27	23.07
PYFA	7.85	9.67	9.92	11.58	4.97
RMBA	30.20	42.26	-44.66	-143.93	-314.74
SKLT	7.00	8.65	11.53	16.56	23.86
SMAR	438.87	621.73	758.55	345.72	513.79
SQBI	9047.00	11725.00	16965.50	18755.77	20673.36
STTP	32.54	32.57	56.97	87.36	94.25
TBLA	52.10	85.33	49.42	17.37	81.61
TCID	653.74	696.48	750.01	798.56	869.90
TSPC	108.64	130.07	143.02	149.81	149.81
ULTJ	37.09	35.08	122.36	112.56	98.10
UNVR	443.90	545.78	634.23	701.52	752.10

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 6: Data Total Asset Turnover Perusahaan

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	0.67	0.95	1.22	1.14	1.15
AISA	0.36	0.49	0.71	0.81	0.70
DLTA	0.77	0.81	0.97	1.00	0.89
DVLA	1.09	1.05	1.01	0.93	0.89
GGRM	1.23	1.07	1.18	1.09	1.12
HMSP	2.11	2.73	2.54	2.74	2.84
ICBP	1.34	1.27	0.84	1.18	1.21
INAF	1.43	1.08	0.97	1.03	1.11
INDF	0.81	0.85	0.84	0.74	0.74
KAEF	1.92	1.94	1.80	1.76	1.52
KLBF	1.45	1.32	1.45	1.41	1.40
MBTO	1.70	1.20	1.18	1.05	1.08
MERK	1.83	1.57	1.64	1.71	1.20
MRAT	0.96	0.96	1.01	0.81	0.87
MYOR	1.64	1.43	1.27	1.24	1.38
PSDN	2.24	2.96	1.91	1.88	1.57
PTSP	2.12	2.19	1.74	1.56	1.28
PYFA	1.40	1.28	1.30	1.10	1.29
RMBA	1.82	1.59	1.42	1.33	1.37
SKLT	1.58	1.61	1.61	1.88	2.06
SMAR	1.62	2.15	1.69	1.30	1.52
SQBI	0.96	0.94	0.98	1.01	1.08
STTP	1.17	1.10	1.03	1.15	1.28
TBLA	0.81	0.88	0.73	0.60	0.86
TCID	1.40	1.46	1.47	1.38	1.25
TSPC	1.43	1.36	1.43	1.27	1.34
ULTJ	0.94	0.96	1.16	1.23	1.34
UNVR	2.26	2.24	2.28	2.30	2.42

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 7: Data Market to Book Value Perusahaan

Kode Emiten	2011	2012	2013	2014	2015
ADES	9.57	4.74	5.42	4.46	2.74
AISA	1.42	0.62	1.22	1.39	1.51
DLTA	3.33	2.98	6.83	8.99	8.17
DVLA	3.09	1.77	2.25	2.69	1.97
GGRM	3.63	4.86	4.07	2.75	3.51
HMSP	12.40	17.20	20.25	19.84	22.89
ICBP	3.06	2.83	1.50	4.48	5.08
INAF	0.80	0.83	1.57	0.80	1.86
INDF	2.55	1.28	1.50	1.51	1.44
KAEF	0.79	1.51	2.85	2.02	4.55
KLBF	6.14	5.30	7.30	6.89	8.74
MBTO	3.66	1.10	0.94	0.72	0.47
MERK	5.95	6.01	8.17	8.27	6.47
MRAT	0.82	0.60	0.54	0.53	0.39
MYOR	4.14	4.51	5.00	5.91	4.56
PSDN	0.83	2.16	0.72	0.52	0.54
PTSP	1.88	2.17	4.55	5.65	7.80
PYFA	0.88	1.14	1.08	0.84	0.75
RMBA	2.72	2.55	2.18	4.68	-2.70
SKLT	0.82	0.79	0.96	0.89	1.35
SMAR	2.46	2.51	2.10	3.48	2.93
SQBI	0.31	3.36	5.83	6.98	0.23
STTP	1.13	1.84	2.37	2.93	4.61
TBLA	1.57	1.81	1.38	1.29	1.64
TCID	1.53	1.52	2.02	2.02	2.75
TSPC	2.95	3.77	5.00	3.79	3.12
ULTJ	2.69	2.61	2.29	6.45	4.74
UNVR	31.12	38.97	40.09	46.63	43.14



Lampiran 8: Hasil Analisis Deskriptif

Model I

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
Return	140	-68.82	1114.29	42.7621	108.26226
CR	140	.67	11.74	2.7115	1.82480
DER	140	-8.34	9.47	.8044	1.21458
EPS	140	-314.74	20673.36	1602.0298	4001.98195
TATO	140	.36	2.96	1.3519	.49562
MBV	140	-2.70	46.63	4.8301	7.78878
Valid N (listwise)	140				

Model II

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
Return2	140	-12.08	23.33	1.1626	4.62141
CR	140	.67	11.74	2.7115	1.82480
DER	140	-8.34	9.47	.8044	1.21458
EPS	140	-314.74	20673.36	1602.0298	4001.98195
TATO	140	.36	2.96	1.3519	.49562
MBV	140	-2.70	46.63	4.8301	7.78878
Valid N (listwise)	140				

C Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.

Lampiran 9: Hasil Uji Normalitas

Model I

One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Unstandardized Residual
N		73
Normal Parameters ^{a,b}	Mean	0E-7
	Std. Deviation	.89623782
	Absolute	.077
Most Extreme Differences	Positive	.047
	Negative	-.077
Kolmogorov-Smirnov Z		.659
Asymp. Sig. (2-tailed)		.778

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

Model II

One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Unstandardized Residual
N		121
Normal Parameters ^{a,b}	Mean	0E-7
	Std. Deviation	3.56763867
	Absolute	.121
Most Extreme Differences	Positive	.121
	Negative	-.094
Kolmogorov-Smirnov Z		1.336
Asymp. Sig. (2-tailed)		.056

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 10: Hasil Uji Autokorelasi

Model I

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR ^b		Enter

a. Dependent Variable: LN_RET_1

b. All requested variables entered.

Model Summary^b

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.217 ^a	.047	-.024	.92908	2.164

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

b. Dependent Variable: LN_RET_1

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	2.871	5	.574	.665	.651 ^b
Residual	57.833	67	.863		
Total	60.705	72			

Dependent Variable: LN_RET_1

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
(Constant)	4.048	.379		10.693	.000
LN_CR	-.160	.456	-.077	-.352	.726
LN_DER	-.071	.283	-.051	-.249	.804
LN_EPS	-.097	.077	-.183	-1.263	.211
LN_TATO	-.193	.376	-.064	-.512	.610
LN_MBV	.329	.196	.243	1.677	.098

a. Dependent Variable: LN_RET_1

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.

Residuals Statistics^a

	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation	N
Predicted Value	3.4309	4.3588	3.7659	.19969	73
Residual	-2.57878	1.66371	.00000	.89624	73
Std. Predicted Value	-1.678	2.969	.000	1.000	73
Std. Residual	-2.776	1.791	.000	.965	73

Dependent Variable: LN_RET_1

Model II

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	MBV, CR, TATO, EPS, DER ^b		Enter

a. Dependent Variable: RETURN_2

b. All requested variables entered.

Model Summary^b

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.160 ^a	.026	-.017	3.64437	1.818

a. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

b. Dependent Variable: RETURN_2

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
Regression	40.219	5	8.044	.606	.696 ^b
Residual	1527.365	115	13.281		
Total	1567.585	120			

a. Dependent Variable: RETURN_2

b. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		



(Constant)	-2.432	1.900		-1.280	.203
CR	.514	.347	.212	1.484	.141
DER	1.170	.786	.184	1.490	.139
EPS	-4.036E-005	.000	-.028	-.244	.808
TATO	.621	.902	.075	.688	.493
MBV	-.003	.118	-.003	-.025	.980

a. Dependent Variable: RETURN_2

Residuals Statistics^a

	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation	N
Predicted Value	-.3040	2.3310	.6182	.57893	121
Residual	-12.58700	12.61665	.00000	3.56764	121
Std. Predicted Value	-1.593	2.958	.000	1.000	121
Std. Residual	-3.454	3.462	.000	.979	121

Dependent Variable: RETURN_2

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 11: Hasil Uji Heterokedastisitas

Model I

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR ^b	.	Enter

a. Dependent Variable: ABS_RES

b. All requested variables entered.

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.231 ^a	.054	-.017	.58241

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	1.286	5	.257	.758	.583 ^b
Residual	22.727	67	.339		
Total	24.013	72			

a. Dependent Variable: ABS_RES

b. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
(Constant)	.648	.237		2.730	.008
LN_CR	-.230	.286	-.175	-.805	.424
LN_DER	-.237	.178	-.274	-1.335	.186
LN_EPS	-.009	.048	-.027	-.186	.853
LN_TATO	.148	.236	.078	.627	.533
LN_MBV	.113	.123	.133	.921	.360

Dependent Variable: ABS_RES

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Model II

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	MBV, CR, TATO, EPS, DER ^b		Enter

a. Dependent Variable: ABS_RES

b. All requested variables entered.

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.147 ^a	.022	-.021	2.61629

a. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	17.432	5	3.486	.509	.769 ^b
Residual	787.175	115	6.845		
Total	804.607	120			

a. Dependent Variable: ABS_RES

b. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
(Constant)	2.229	1.364		1.634	.105
CR	.142	.249	.082	.570	.570
DER	.626	.564	.137	1.110	.269
EPS	1.557E-005	.000	.015	.131	.896
TATO	-.511	.647	-.086	-.790	.431
MBV	-.004	.085	-.005	-.041	.967

a. Dependent Variable: ABS_RES

C

Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 12: Hasil Uji Multikolinieritas

Model I

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR ^b		Enter

a. Dependent Variable: LN_RET_1

b. All requested variables entered.

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.217 ^a	.047	-.024	.92908

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	2.871	5	.574	.665	.651 ^b
Residual	57.833	67	.863		
Total	60.705	72			

Dependent Variable: LN_RET_1

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics	
	B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF
1 (Constant)	4.048	.379		10.693	.000		
LN_CR	-.160	.456	-.077	-.352	.726	.298	3.353
LN_DER	-.071	.283	-.051	-.249	.804	.335	2.983
LN_EPS	-.097	.077	-.183	-1.263	.211	.677	1.477
LN_TATO	-.193	.376	-.064	-.512	.610	.903	1.108
LN_MBV	.329	.196	.243	1.677	.098	.677	1.477

a. Dependent Variable: LN_RET_1

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Model II

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	MBV, CR, TATO, EPS, DER ^b		Enter

a. Dependent Variable: RETURN_2

b. All requested variables entered.

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.160 ^a	.026	-.017	3.64437

a. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
Regression	40.219	5	8.044	.606	.696 ^b
Residual	1527.365	115	13.281		
Total	1567.585	120			

a. Dependent Variable: RETURN_2

b. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics	
	B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF
(Constant)	-2.432	1.900		-1.280	.203		
CR	.514	.347	.212	1.484	.141	.414	2.418
DER	1.170	.786	.184	1.490	.139	.558	1.793
EPS	-4.036E-005	.000	-.028	-.244	.808	.630	1.588
TATO	.621	.902	.075	.688	.493	.722	1.385
MBV	-.003	.118	-.003	-.025	.980	.694	1.441

a. Dependent Variable: RETURN_2



Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

- Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
- Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Lampiran 13: Hasil Uji Regresi Linier Berganda

Model I

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR ^b		Enter

a. Dependent Variable: LN_RET_1

b. All requested variables entered.

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.217 ^a	.047	-.024	.92908

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	Df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	2.871	5	.574	.665	.651 ^b
Residual	57.833	67	.863		
Total	60.705	72			

Dependent Variable: LN_RET_1

a. Predictors: (Constant), LN_MBV, LN_DER, LN_TATO, LN_EPS, LN_CR

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
(Constant)	4.048	.379		10.693	.000
LN_CR	-.160	.456	-.077	-.352	.726
LN_DER	-.071	.283	-.051	-.249	.804
LN_EPS	-.097	.077	-.183	-1.263	.211
LN_TATO	-.193	.376	-.064	-.512	.610
LN_MBV	.329	.196	.243	1.677	.098

a. Dependent Variable: LN_RET_1

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Model II

Variables Entered/Removed^a

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	MBV, CR, TATO, EPS, DER ^b		Enter

a. Dependent Variable: RETURN_2

b. All requested variables entered.

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.160 ^a	.026	-.017	3.64437

a. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	40.219	5	8.044	.606	.696 ^b
Residual	1527.365	115	13.281		
Total	1567.585	120			

a. Dependent Variable: RETURN_2

b. Predictors: (Constant), MBV, CR, TATO, EPS, DER

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
(Constant)	-2.432	1.900		-1.280	.203
CR	.514	.347	.212	1.484	.141
DER	1.170	.786	.184	1.490	.139
EPS	-4.036E-005	.000	-.028	-.244	.808
TATO	.621	.902	.075	.688	.493
MBV	-.003	.118	-.003	-.025	.980

a. Dependent Variable: RETURN_2

C

Hak cipta milik IBI KKG (Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie)

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.