

LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Sebelum Transformasi

Tahun	Perusahaan	Return Saham	DER	NPM	ROE
2016	ADMG	126	0,55	7,35	8,38
	ERTX	165	1,63	2,21	7,8
	INDR	810	1,83	0,21	0,49
	PBRX	460	1,28	2,76	5,84
	RICY	154	2,12	1,15	3,4
	SRIL	230	1,86	8,73	17,93
	TRIS	336	0,85	2,8	7,27
	TFCO	1020	0,11	3,34	2,14
	UNIT	360	0,77	0,83	0,35
2017	ADMG	246	0,58	2,88	3,28
	ERTX	118	2,03	1,37	3,75
	INDR	1250	1,76	0,18	0,35
	PBRX	535	1,5	2,74	4,71
	RICY	150	2,14	0,2	0,53
	SRIL	380	1,78	11	16,9
	TRIS	308	0,64	2,82	4,62
	TFCO	790	0,11	5,79	3,08
	UNIT	228	0,75	0,92	0,29
2018	ADMG	314	0,22	3,88	4,58
	ERTX	124	2,31	1,86	5,33
	INDR	5925	1,33	16,62	29,1
	PBRX	550	1,45	3,62	6,56
	RICY	164	2,19	0,39	1,35
	SRIL	358	1,64	12,3	18,78
	TRIS	220	0,67	3,87	6,6
	TFCO	665	0,11	0,29	0,17
	UNIT	258	0,71	0,7	0,24
2019	ADMG	186	0,19	15	12
	ERTX	140	2,49	1,76	5,49
	INDR	2430	1,07	9,17	14,6
	PBRX	510	1,28	4,21	7,77
	RICY	149	2,42	0,43	1,3
	SRIL	260	1,49	10,8	16,5
	TRIS	266	0,65	0,85	1,57
	TFCO	474	0,06	1,68	0,83
	UNIT	179	0,7	0,9	0,3

Lampiran 2. Data Setelah Transformasi

ReturnSaham	DER	NPM	ROE	RES_1	LnU2i	LnX1	LnX2	LnX3	RES_2
126	0,55	7,35	8,38	-635,85	12,91	-0,6	1,99	2,13	0,82561
165	1,63	2,21	7,8	-739,261	13,21	0,49	0,79	2,05	0,74641
810	1,83	0,21	0,49	925,2562	13,66	0,6	-1,56	-0,71	3,4967
460	1,28	2,76	5,84	-183,121	10,42	0,25	1,02	1,76	-1,52514
154	2,12	1,15	3,4	11,97984	4,97	0,75	0,14	1,22	-6,64457
230	1,86	8,73	17,93	-1454,71	14,57	0,62	2,17	2,89	2,07531
336	0,85	2,8	7,27	-687,715	13,07	-0,16	1,03	1,98	0,58359
1020	0,11	3,34	2,14	633,7431	12,9	-2,21	1,21	0,76	1,42376
360	0,77	0,83	0,35	196,536	10,56	-0,26	-0,19	-1,05	1,67686
246	0,58	2,88	3,28	-214,463	10,74	-0,54	1,06	1,19	-0,68242
118	2,03	1,37	3,75	-86,3945	8,92	0,71	0,31	1,32	-2,7147
1250	1,76	0,18	0,35	1359,572	14,43	0,57	-1,71	-1,05	4,63429
535	1,5	2,74	4,71	151,5016	10,04	0,41	1,01	1,55	-1,4952
150	2,14	0,2	0,53	367,5955	11,81	0,76	-1,61	-0,63	1,56637
380	1,78	11	16,9	-891,534	13,59	0,58	2,4	2,83	1,36728
308	0,64	2,82	4,62	-356,514	11,75	-0,45	1,04	1,53	-0,16579
790	0,11	5,79	3,08	546,3795	12,61	-2,21	1,76	1,12	1,04217
228	0,75	0,92	0,29	78,06206	8,72	-0,29	-0,08	-1,24	0,19864
314	0,22	3,88	4,58	-365,203	11,8	-1,51	1,36	1,52	-0,37357
124	2,31	1,86	5,33	-179,038	10,38	0,84	0,62	1,67	-1,46998
5925	1,33	16,62	29,1	3186,07	16,13	0,29	2,81	3,37	3,28142
550	1,45	3,62	6,56	-46,1857	7,67	0,37	1,29	1,88	-4,1597
164	2,19	0,39	1,35	288,802	11,33	0,78	-0,94	0,3	0,22705
358	1,64	12,3	18,78	-1112,37	14,03	0,49	2,51	2,93	1,70161
220	0,67	3,87	6,6	-629,446	12,89	-0,4	1,35	1,89	0,71721
665	0,11	0,29	0,17	231,3586	10,89	-2,21	-1,24	-1,77	1,20715
258	0,71	0,7	0,24	75,45237	8,65	-0,34	-0,36	-1,43	0,15768
186	0,19	15	12	-369,764	11,83	-1,66	2,71	2,48	-0,73873
140	2,49	1,76	5,49	-137,244	9,84	0,91	0,57	1,7	-2,05733
2430	1,07	9,17	14,6	1059,948	13,93	0,07	2,22	2,68	1,52032
510	1,28	4,21	7,77	-272,297	11,21	0,25	1,44	2,05	-0,80627
149	2,42	0,43	1,3	368,4224	11,82	0,88	-0,84	0,26	0,90919
260	1,49	10,8	16,5	-1073,52	13,96	0,4	2,38	2,8	1,66866
266	0,65	0,85	1,57	-136,233	9,83	-0,43	-0,16	0,45	-1,45319
474	0,06	1,68	0,83	82,90975	8,84	-2,81	0,52	-0,19	-2,08451
179	0,7	0,9	0,3	7,26986	3,97	-0,36	-0,11	-1,2	-4,65616

Lampiran 3. Hasil Statistik Deskriptif

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
ReturnSaham	36	118,00	5925,00	578,8333	1013,34542
DER	36	,06	2,49	1,2019	,74596
NPM	36	,18	16,62	4,0447	4,41373
ROE	36	,17	29,10	6,2272	6,73194
Valid N (listwise)	36				

Lampiran 4. Uji Normalitas

One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Unstandardized Residual
N		36
Normal Parameters ^{a,b}	Mean	0E-7
	Std. Deviation	809,19994084
	Absolute	,158
Most Extreme Differences	Positive	,158
	Negative	-,102
Kolmogorov-Smirnov Z		,947
Asymp. Sig. (2-tailed)		,332

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

Lampiran 5. Uji Autokorelasi

Model Summary^b

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	,602 ^a	,362	,303	846,28155	2,067

a. Predictors: (Constant), ROE, DER, NPM

b. Dependent Variable: ReturnSaham

Lampiran 6. Tabel Durbin Watson

N	K=3	
	dL	dU
35	1,2833	1,6528
.	.	.
.	.	.
.	.	.
.	.	.
40	1,3384	1,6589

Lampiran 7. Uji Multikolinieritas

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics		
	B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF	
1	(Constant)	480,017	344,439		1,394	,173		
	DER	-355,022	241,300	-,261	-1,471	,151	,632	1,583
	NPM	-120,670	100,002	-,526	-1,207	,236	,105	9,521
	ROE	162,771	65,933	1,081	2,469	,019	,104	9,628

a. Dependent Variable: ReturnSaham

Lampiran 8. Uji Heteroskedastisitas

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
1 (Constant)	10,218	,553		18,485	,000
Ln _{x1}	-,513	,563	-,200	-,912	,369
Ln _{x2}	-,873	,878	-,430	-,994	,327
Ln _{x3}	1,553	,787	,867	1,972	,057

a. Dependent Variable: LnU_{2i}

Lampiran 9. Hasil Uji t

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	
	B	Std. Error	Beta			
1	(Constant)	480,017	344,439		1,394	,173
	DER	-355,022	241,300	-,261	-1,471	,151
	NPM	-120,670	100,002	-,526	-1,207	,236
	ROE	162,771	65,933	1,081	2,469	,019

a. Dependent Variable: ReturnSaham

Lampiran 10. Hasil Uji F

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	13022253,951	3	4340751,317	6,061	,002 ^b
Residual	22918159,049	32	716192,470		
Total	35940413,000	35			

a. Dependent Variable: ReturnSaham

b. Predictors: (Constant), ROE, DER, NPM

Lampiran 11. Hasil Uji Determinasi

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	,602 ^a	,362	,303	846,28155

a. Predictors: (Constant), ROE, DER, NPM