

HASIL DESKRIPTIF STATISTIK

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
RETURN	114	-.882	2.846	.14525	.516604
PERS	114	.002	.443	.07371	.104300
CETR	114	.185	.489	.27632	.065689
Valid N (listwise)	114				

UJI HETEROSKEDASTISITAS

ANOVA^a

Model	Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1 Regression	3.260	3	1.087	1.683	.175 ^b
Residual	71.030	110	.646		
Total	74.290	113			

a. Dependent Variable: ABS_RES_1

b. Predictors: (Constant), PERS, PERS_CETR, CETR

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
	B	Std. Error	Beta		
1 (Constant)	1.365	.276		4.938	.000
CETR	.364	.260	.190	1.396	.165
PERS_CETR	-.806	.374	-.291	-2.154	.533
PERS	.057	.132	.041	.433	.666

a. Dependent Variable: ABS_RES_1

UJI HIPOTESIS

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Correlations			Collinearity Statistics	
	B	Std. Error	Beta			Zero - order	Partial	Part	Tolerance	VIF
(Constant)	-2.925	.486		-6.015	.000					
CETR	-1.180	.458	-.346	-2.575	.011	-.197	-.238	-.238	.471	2.121
PERS_CETR	.941	.658	.191	1.430	.016	-.056	.135	.132	.478	2.094
PERS	.245	.232	.098	1.053	.295	.063	.100	.097	.979	1.021

a. Dependent Variable: RETURN

LAMPIRAN : HASIL OLAH DATA LAPORAN KEUANGAN

NO	KODE SAHAM	NAMA EMITEN	TAHUN	RETURN	PERS	PERS_1	CETR
1	AALI	Astra Agro Lestari Tbk	2014	(0,016)	398,574	0,399	0,288
			2015	(0,346)	564,352	0,564	0,408
			2016	0,111	180,782	0,181	0,043
2	ADES	Akasha Wira International Tbk	2014	(0,011)	25,064	0,025	0,253
			2015	(0,250)	17,868	0,018	0,257
			2016	(0,020)	18,929	0,019	0,092
3	AKPI	Argha Karya Prima Ind Tbk	2014	0,127	24,420	0,024	0,435
			2015	0,113	22,603	0,023	0,459
			2016	0,011	19,005	0,019	0,310
4	AMFG	Asahimas Flat Glass Tbk	2014	0,168	251,184	0,251	0,233
			2015	(0,150)	336,928	0,337	0,265
			2016	(0,036)	258,686	0,259	0,253
5	ARTI	Ratu Prabu Energi Tbk	2014	(0,125)	11,276	0,011	0,125
			2015	(0,143)	4,935	0,005	0,604
			2016	0,667	2,587	0,003	0,142
6	BATA	Sepatu Bata Tbk	2014	(0,026)	12,701	0,013	0,284
			2015	0,053	19,335	0,019	0,087
			2016	0,044	28,467	0,028	0,353
7	BISI	Bisi International Tbk	2014	0,362	13,432	0,013	0,210
			2015	0,696	17,650	0,018	0,204
			2016	0,418	27,519	0,028	0,260
8	BUDI	Budi Acid Jaya Tbk	2014	(0,031)	3,147	0,003	0,345
			2015	0,011	3,440	0,003	0,595
			2016	0,021	3,946	0,004	0,269
9	CPIN	CPIN Charoen Pokphand Indonesia Tbk	2014	0,072	51,605	0,052	0,171
			2015	(0,312)	31,832	0,032	0,197
			2016	0,188	34,414	0,034	0,435
10	CTTH	Citatah Tbk	2014	0,175	1,258	0,001	0,574
			2015	(0,209)	1,007	0,001	0,511
			2016	0,509	1,662	0,002	0,220
11	DLTA	Delta Djakarta Tbk	2014	0,026	5.394,777	5,395	0,241
			2015	0,327	5.721,225	5,721	0,232
			2016	(0,034)	3.766,382	3,766	0,022

LAMPIRAN : HASIL OLAH DATA LAPORAN KEUANGAN

NO	KODE SAHAM	NAMA EMITEN	TAHUN	RETURN	PERS	PERS_1	CETR
12	DPNS	Duta Pertiwi Nusantara Tbk	2014	(0,249)	64,436	0,064	0,155
			2015	0,096	13,396	0,013	0,167
			2016	0,034	9,492	0,009	0,185
13	DSFI	Dharma Samudera Fishing Ind Tbk	2014	2,846	2,310	0,002	0,239
			2015	(0,475)	2,908	0,003	0,381
			2016	0,505	3,720	0,004	0,253
14	DVLA	Darya-Varia Laboratoria Tbk	2014	(0,249)	38,700	0,039	0,236
			2015	(0,231)	23,853	0,024	0,253
			2016	0,365	31,961	0,032	0,291
15	EKAD	Ekadharna International Tbk	2014	0,304	18,811	0,019	0,306
			2015	(0,214)	21,239	0,021	0,291
			2016	0,457	23,750	0,024	0,234
16	GGRM	Gudang Garam Tbk	2014	0,420	744,415	0,744	0,251
			2015	(0,115)	909,564	0,910	0,253
			2016	0,189	1.082,485	1,082	0,253
17	ICBP	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk	2014	0,254	123,510	0,124	0,253
			2015	0,008	143,282	0,143	0,271
			2016	0,299	166,604	0,167	0,272
18	IGAR	Champion Pacific Indonesia Tbk	2014	0,068	12,889	0,013	0,276
			2015	(0,327)	19,769	0,020	0,187
			2016	1,453	16,557	0,017	0,276
19	INAI	Indal Aluminium Industry Tbk	2014	0,167	18,168	0,018	0,324
			2015	0,151	26,125	0,026	0,499
			2016	0,600	44,330	0,044	0,388
20	INCI	Intanwijaya Internasional Tbk	2014	(0,048)	15,113	0,015	0,037
			2015	0,324	16,172	0,016	0,118
			2016	(0,029)	26,468	0,026	0,249
21	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk	2014	0,007	110,691	0,111	0,293
			2015	(0,215)	174,903	0,175	0,349
			2016	0,495	137,077	0,137	0,272
22	JPFA	JAPFA Comfeed Indonesia Tbk	2014	(0,240)	21,135	0,021	0,289
			2015	(0,363)	13,347	0,013	0,248
			2016	1,388	16,653	0,017	0,215

LAMPIRAN : HASIL OLAH DATA LAPORAN KEUANGAN

NO	KODE SAHAM	NAMA EMITEN	TAHUN	RETURN	PERS	PERS_1	CETR
23	KAEF	Kimia Farma (Persero) Tbk	2014	1,363	13,210	0,013	0,251
			2015	(0,420)	15,809	0,016	0,252
			2016	2,235	15,553	0,016	0,291
24	KBLM	Kabelindo Murni Tbk	2014	(0,019)	3,177	0,003	0,251
			2015	(0,097)	6,771	0,007	0,406
			2016	0,714	5,501	0,006	0,425
25	KDSI	Kedawung Setia Industrial Tbk	2014	0,374	28,953	0,029	0,233
			2015	(0,451)	36,332	0,036	0,230
			2016	0,750	9,742	0,010	0,260
26	KLBF	Kalbe Farma Tbk	2014	0,148	14,107	0,014	0,232
			2015	0,065	15,100	0,015	0,244
			2016	0,036	14,870	0,015	0,239
27	LION	Lion Metal Works Tbk	2014	(0,225)	394,828	0,395	0,222
			2015	(0,882)	290,809	0,291	0,213
			2016	(0,045)	271,699	0,272	0,225
28	LMSH	Lionmesh Prima Tbk	2014	0,055	488,848	0,489	0,326
			2015	0,069	283,958	0,284	0,489
			2016	0,032	96,457	0,096	0,337
29	LSIP	PP London Sumatra Indonesia Tbk	2014	(0,005)	36,097	0,036	0,226
			2015	(0,339)	44,043	0,044	0,236
			2016	0,392	30,124	0,030	0,239
30	MLBI	Multi Bintang Indonesia Tbk	2014	0,042	18.038,078	18,038	0,263
			2015	(0,318)	124,227	0,124	0,264
			2016	0,378	78,153	0,078	0,256
31	MYOR	Mayora Indah Tbk	2014	(0,196)	366,302	0,366	0,226
			2015	0,352	143,503	0,144	0,238
			2016	0,456	442,945	0,443	0,248
32	PTBA	Tambang Batubara Bukit Asam Tbk	2014	0,202	258,326	0,258	0,228
			2015	(0,653)	253,368	0,253	0,235
			2016	1,884	279,500	0,279	0,249
33	RICY	Ricky Putra Globalindo Tbk	2014	0,006	6,965	0,007	0,296
			2015	(0,081)	8,952	0,009	0,399
			2016	(0,031)	9,293	0,009	0,399

LAMPIRAN : HASIL OLAH DATA LAPORAN KEUANGAN

NO	KODE SAHAM	NAMA EMITEN	TAHUN	RETURN	PERS	PERS_1	CETR
34	ROTI	Nippon Indosari Corpindo Tbk	2014	0,100	10,918	0,011	0,254
			2015	0,132	12,920	0,013	0,285
			2016	0,285	18,890	0,019	0,243
35	RUIS	Radiant Utama Interinsco Tbk	2014	0,090	18,522	0,019	0,276
			2015	(0,009)	25,411	0,025	0,391
			2016	0,098	22,800	0,023	0,475
36	SGRO	Sampoerna Agro Tbk	2014	0,024	23,045	0,023	0,314
			2015	(0,024)	65,945	0,066	0,354
			2016	0,144	51,396	0,051	0,722
37	SIDO	Industri Jamu dan Farmasi Sido Muncul Tbk	2014	(0,164)	10,242	0,010	0,239
			2015	(0,107)	9,697	0,010	0,219
			2016	(0,046)	9,885	0,010	0,266
38	SKBM	Sekar Bumi Tbk	2014	0,055	22,679	0,023	0,188
			2015	0,034	29,420	0,029	0,251
			2016	0,067	14,682	0,015	0,536
39	SMBR	Semen Baturaja Tbk	2014	0,086	10,690	0,011	0,170
			2015	(0,242)	10,798	0,011	0,201
			2016	0,007	11,744	0,012	0,258
41	SQBB	Taisho Pharmaceutical Indonesia Tbk	2014	0,023	5.188,112	5,188	0,251
			2015	0,333	5.724,412	5,724	0,244
			2016	0,100	5.165,944	5,166	0,249
41	SRSN	Indo Acidatama Tbk	2014	0,176	2,189	0,002	0,514
			2015	0,100	2,084	0,002	0,252
			2016	0,056	1,710	0,002	0,643
42	SSMS	Sawit Sumbermas Sarana Tbk	2014	0,892	22,474	0,022	0,276
			2015	0,081	24,129	0,024	0,243
			2016	(0,222)	20,501	0,021	0,302
43	STAR	Star Petcohem Tbk	2014	0,111	1,201	0,001	0,929
			2015	0,100	341,060	0,341	0,884
			2016	0,018	133,761	0,134	0,922
44	TBLA	Tunas Baru Lampung Tbk	2014	0,573	6,687	0,007	0,224
			2015	(0,318)	26,254	0,026	0,237
			2016	0,922	12,755	0,013	0,226

LAMPIRAN : HASIL OLAH DATA LAPORAN KEUANGAN

NO	KODE SAHAM	NAMA EMITEN	TAHUN	RETURN	PERS	PERS_1	CETR
45	TCID	Mandom Indonesia Tbk	2014	0,043	262,534	0,263	0,272
			2015	0,167	290,282	0,290	0,066
			2016	0,036	699,815	0,700	0,268
46	TOTO	Surya Toto Indonesia Tbk	2014	0,051	158,125	0,158	0,231
			2015	(0,024)	94,444	0,094	0,252
			2016	0,050	93,702	0,094	0,329
47	TRIS	Trisula International Tbk	2014	(0,110)	17,244	0,017	0,246
			2015	(0,154)	12,066	0,012	0,254
			2016	0,116	12,465	0,012	0,390
48	TRST	Trias Sentosa Tbk	2014	0,141	7,108	0,007	0,522
			2015	(0,562)	6,316	0,006	0,505
			2016	0,010	5,267	0,005	0,457
49	TSPC	Tempo Scan Pacific Tbk	2014	(0,076)	45,329	0,045	0,207
			2015	(0,391)	40,421	0,040	0,252
			2016	0,129	38,751	0,039	0,241
50	ULTJ	Ultrajaya Milk Industry and Trading Company	2014	(0,114)	37,320	0,037	0,245
			2015	0,059	32,167	0,032	0,253
			2016	0,162	59,344	0,059	0,239
51	UNIT	Nusantara Inti Corpora Tbk	2014	0,100	14,841	0,015	0,937
			2015	(0,273)	18,822	0,019	0,768
			2016	0,500	6,190	0,006	0,551
52	UNVR	Unilever Indonesia Tbk	2014	0,100	226,998	0,227	0,252
			2015	0,010	251,283	0,251	0,253
			2016	0,010	248,182	0,248	0,254