

Lampiran 1

Tabel 3.1
Populasi Sampel Penelitian

Kategori	Jumlah Saham
Saham LQ45	45 Saham
Saham Tidak Memenuhi Kriteria Pengujian	(16 Saham)
Total Saham Memenuhi Kriteria Pengujian	29 Saham

Sumber: data sekunder yang diolah, 2015



Lampiran 2

Tabel 3.2.

Tabel Daftar Sampel Nama Saham LQ45

No	Kode Saham	Nama Emiten	No	Kode Saham	Nama Emiten
1	AALI	Astra Agro Lestari Tbk	16	INDY	Indika Energi Tbk
2	ADRO	Adaro Energy Tbk	17	INTP	Indocement Tunggul Prakasa Tbk
3	ANTM	Aneka Tambang Tbk	18	ITMG	Indo Tambangraya Megah Tbk
4	ASII	Astra International Tbk	19	JSMR	Jasa Marga (Persero) Tbk
5	BBCA	Bank Central Asia Tbk	20	KLBF	Kalbe Farma Tbk
6	BBNI	Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk	21	LPKR	Lippo Karawaci Tbk
7	BBRI	Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk	22	LSIP	London Sumatera Plantation Tbk
8	BDMN	Bank Danamon Tbk	23	PGAS	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk
9	BMRI	Bank Mandiri (Perseri) Tbk	24	PTBA	Tambang Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk
10	BUMI	Bumi Resources Tbk	25	SMGR	Semen Gresik (Persero) Tbk
11	ELTY	Bakrieland Development Tbk	26	TINS	Timah (Persero) Tbk
12	ENRG	Energi Mega Persada Tbk	27	TLKM	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk
13	GGRM	Gudang Garam Tbk	28	UNTR	United Tractors Tbk
14	INCO	International Nickel Indonesia Tbk	29	UNVR	Unilever Indonesia Tbk
15	INDF	Indofood Sukses Makmur Tbk			

Sumber : data sekunder yang diolah, 2015

Lampiran 3

NO	KODE SAHAM	Price Earning Ratio (PER)			Debt to Equity Ratio (DER)			Return On Equity (ROE)			RETURN SAHAM		
		2010	2011	2012	2010	2011	2012	2010	2011	2012	2010	2011	2012
1	AALI	20,46	13,68	13,9	0,19	0,21	0,33	41,1	39,55	37,6	-0,07	-0,02	0,04
2	ADRO	36,95	11,16	31,71	1,18	1,32	1,2	27,18	41,05	20,13	0,20	-0,17	-0,04
3	ANTM	13,88	8,03	14,57	0,28	0,41	0,61	23,72	23,85	7,99	0,03	-0,11	-0,23
4	ASII	15,37	14,03	13,58	1,1	1,02	1,03	42,65	33,98	31,06	0,72	1,09	11,10
5	BBCA	18,61	18,31	20,5	8,51	8,09	7,66	32,23	32,4	21,13	0,15	0,43	0,16
6	BBNI	17,62	11,83	10,36	6,5	6,9	6,66	16,56	19,72	20,45	0,70	0,14	0,06
7	BBRI	11,29	10,89	9,43	10,02	8,43	7,5	40,65	37,65	36,77	1,62	0,43	0,09
8	BDMN	16,64	11,65	13,4	5,4	4,49	4,26	21,69	17,85	19,1	0,25	-0,23	0,32
9	BMRI	14,81	12,62	11,99	9,81	7,81	7,31	33,63	26,35	26,79	0,30	0,14	0,25
10	BUMI	22,49	23,16	-1,98	4,06	5,26	14,29	61,76	50,88	- 127,44	0,12	-0,05	-0,76
11	ELTY	35,07	324,59	-4,17	0,82	0,62	0,71	2,81	0,99	-1,62	-0,50	0,05	-0,60
12	ENRG	-80,75	28,59	32,11	1	1,83	1,97	-0,62	5,29	4,86	-0,38	0,40	-0,29
13	GGRM	18,56	24,08	26,7	0,44	0,59	0,59	26,57	26,94	15,86	0,58	0,57	-0,02
14	INCO (VALE INDONESIA)	12,34	10,51	63,12	0,3	0,37	0,36	34,61	25,57	2,28	12,63	-0,91	-0,33
15	INDF	14,5	8,05	10,02	1,34	0,7	0,71	32,37	20,1	15,03	0,33	0,04	0,27
16	INDY	31,84	9,46	5,68	1,1	1,36	1,26	16,7	17,36	10,45	0,73	-0,40	-0,34

17	INTP	18,21	17,43	18,4	0,17	0,15	0,17	32,49	29,92	32,13	0,02	0,27	0,32
18	ITMG	31,39	8,74	10,11	0,51	0,46	0,49	38,47	67,54	58,97	0,54	-0,18	0,26
19	JSMR	19,51	21,61	22,04	1,37	1,32	1,44	19,07	18,68	17,22	0,73	0,50	0,30
20	KLBF	25,66	22,43	31,87	0,23	0,27	0,27	32,95	30,5	24,12	0,91	0,38	7,27
21	LPKR	27,99	26,26	9,36	1,03	0,94	1,06	9,33	10,47	9,82	0,08	0,18	0,56
22	LSIP	16,97	7,34	12,32	0,22	0,16	0,2	30,34	35,8	21,85	0,55	4,25	0,02
23	PGAS	17,19	12,49	13,62	1,22	0,8	0,66	58,14	44,54	48,76	0,16	-0,17	0,43
24	PTBA	26,32	12,95	11,82	0,36	0,41	0,5	40,83	49,71	45,99	0,18	0,04	-0,13
25	SMGR	15,43	17,15	33,33	0,29	0,35	0,46	39,33	34,83	34,61	0,00	0,49	0,41
26	TINS	14,6	9,37	15,52	0,4	0,43	0,43	26,82	27,58	12,43	0,25	-0,29	-0,05
27	TLKM	13,89	9,18	9,68	0,98	0,69	0,66	48,21	34,2	36,17	-0,05	0,09	0,61
28	UNTR	20,44	16,76	11,95	0,84	-0,69	0,56	31,37	28,3	23,05	0,25	0,40	-0,23
29	UNVR	37,17	34,45	32,66	1,15	1,85	1,43	112,19	151,45	96,01	0,36	0,34	0,13



Lampiran 4

RETURN SAHAM			Average	Extrem	Nama Perusahaan data ekstrem
2010 2011	2011 - 2012	2012 - 2013			
-0,07	-0,02	0,04	-0,02	0	
0,20	-0,17	-0,04	0,00	0	
0,03	-0,11	-0,23	-0,10	0	
0,72	1,09	11,10	4,30	1	ASII
0,15	0,43	0,16	0,25	0	
0,70	0,14	0,06	0,30	0	
1,62	0,43	0,09	0,71	0	
0,25	-0,23	0,32	0,11	0	
0,30	0,14	0,25	0,23	0	
0,12	-0,05	-0,76	-0,23	0	
-0,50	0,05	-0,60	-0,35	0	
-0,38	0,40	-0,29	-0,09	0	
0,58	0,57	-0,02	0,37	0	
12,63	-0,91	-0,33	3,80	1	INCO
0,33	0,04	0,27	0,21	0	
0,73	-0,40	-0,34	0,00	0	
0,02	0,27	0,32	0,20	0	
0,54	-0,18	0,26	0,21	0	
0,73	0,50	0,30	0,51	0	
0,91	0,38	7,27	2,86	1	KLBF
0,08	0,18	0,56	0,28	0	
0,55	4,25	0,02	1,61	1	LSIP
0,16	-0,17	0,43	0,14	0	
0,18	0,04	-0,13	0,03	0	
0,00	0,49	0,41	0,30	0	
0,25	-0,29	-0,05	-0,03	0	
-0,05	0,09	0,61	0,22	0	
0,25	0,40	-0,23	0,14	0	
0,36	0,34	0,13	0,28	0	

Lampiran 5

Tabel 4.2.

One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

	Price Earning Ratio	Debt to Equity Ratio	Return On Equity	Return Saham
N	29	29	29	29
Normal Parameters				
Mean	20.2859	2.0941	29.4000	.5800
Std. Deviation	20.29009	2.84908	22.25478	1.13993
Most Extreme Differences				
Absolute	.281	.362	.187	.359
Positive	.273	.362	.187	.359
Negative	-.281	-.249	-.137	-.212
Kolmogorov-Smirnov Z	1.513	1.949	1.005	1.935
Asymp. Sig. (2-tailed)	.021	.001	.265	.001

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Case Processing Summary

	Cases					
	Valid		Missing		Total	
	N	Percent	N	Percent	N	Percent
Return Saham	29	100.0%	0	.0%	29	100.0%

Descriptives

		Statistic	Std. Error	
Return Saham	Mean	.5600	.21168	
	95% Confidence Interval for Mean	Lower Bound	.1264	
		Upper Bound	.9936	
	5% Trimmed Mean	.4093		
	Median	.2100		
	Variance	1.299		
	Std. Deviation	1.13993		
	Minimum	-.35		
	Maximum	4.30		
	Range	4.65		
	Interquartile Range	.34		
	Skewness	2.496	.434	
	Kurtosis	5.489	.845	

Tabel 4.3.
Data ekstrem

Return Saham Stem-and-Leaf Plot

Frequency Stem & Leaf

```

2.00  -0. 23
4.00  -0. 0001
6.00   0. 0001111
11.00  0. 2222222333
1.00   0. 5
1.00   0. 7
4.00 Extremes (>=1.6)

```

Stem width: 1.00
Each leaf: 1 case(s)

Sumber : data yang telah diolah, 2015

Lampiran 6

	PER	DER	ROE	RS	RES 1
1	16,01	0,24	39,42	-0,02	-0,173
2	26,61	1,23	29,45	0	-0,10497
3	12,16	0,43	18,52	-0,1	-0,19245
4	19,14	8,09	28,59	0,25	-0,01223
5	13,27	6,69	18,91	0,3	0,08352
6	10,54	8,65	38,36	0,71	0,37527
7	13,9	4,72	19,55	0,11	-0,06729
8	13,14	8,31	28,92	0,23	-0,05582
9	14,56	7,87	-4,93	-0,23	-0,37978
10	118,5	0,72	0,73	-0,35	-0,06525
11	-6,68	1,6	3,18	-0,09	-0,20669
12	23,11	0,54	23,12	0,37	0,29142
13	10,86	0,92	22,5	0,21	0,08934
14	15,66	1,24	14,84	0	-0,0849
15	18,01	0,16	31,51	0,2	0,08332
16	16,75	0,49	54,99	0,21	-0,00237
17	21,05	1,38	18,32	0,51	0,42578
18	21,2	1,01	9,87	0,28	0,23437
19	14,43	0,89	50,48	0,14	-0,07098
20	17,03	0,42	45,51	0,03	-0,14569
21	21,97	0,37	36,26	0,3	0,1737
22	13,16	0,42	22,28	-0,03	-0,13291
23	10,92	0,78	39,53	0,22	0,04049
24	16,38	0,24	27,57	0,14	0,03114
25	34,76	1,48	119,88	0,28	-0,13402

Lampiran 7

Tabel 4.4

Descriptive Statistics						
	N	Range	Minimum	Maximum	Mean	Std.
	Statistic	Statistic	Statistic	Statistic	Statistic	Statistic
Price Earning Ratio	25	125.18	-6.68	118.50	20.2576	21.71397
Debt to Equity Ratio	25	8.49	0.16	8.65	2.3556	2.98897
Return On Equity	25	124.81	-4.93	119.88	29.4944	23.93704
Return Saham	25	1.06	-0.35	0.71	0.1468	0.22713
Valid N (listwise)	25					

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Tabel 4.5

One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Unstandardize Residual
N		25
Normal paramameters	Mean	.1468
	Std. Deviation	.22713
Most Extreme Differences	Absolute	.130
	Positive	.130
	Negative	-.113
Kolmogorov-Smirnov Z		.650
Asymp. Sig. (2-tailed)		.792
a. Test distribution is normal.		
b. Calculated from data.		

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Lampiran 8

Tabel 4.6
Nilai Tolerance dan VIF

Colinearity Statistics	
Tolerance	VIF
.967	1.034
.945	1.058
.968	1.034

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015



Lampiran 9

Tabel 4.7

Runs Test

	Unstandardized Residual
Test Value ^a	-.05582
Cases < Test Value	12
Cases \geq Test Value	13
Total Cases	25
Number of Runs	13
Z	.000
Asymp. Sig. (2-tailed)	1.000

a. Median

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Tabel 4.8

Tabel Durbin Watson

Model	Durbin - Watson
1	1.723

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Lampiran 10

Tabel 4.9

Tabel Uji Korelasi dan Rank Spearman

Correlations

			Price Earning Ratio	Debt to Equity Ratio	Return On Equity	Return Saham
Spearman's rho	Price Earning Ratio	Correlation Coefficient	1.000	-.258	.095	.148
		Sig. (1-tailed)	.	.107	.328	.240
		N	25	25	25	25
	Debt to Equity Ratio	Correlation Coefficient	-.258	1.000	-.287	.257
		Sig. (1-tailed)	.107	.	.089	.107
		N	25	25	25	25
	Return On Equity	Correlation Coefficient	.095	-.287	1.000	.333
		Sig. (1-tailed)	.328	.089	.	.052
		N	25	25	25	25
	Return Saham	Correlation Coefficient	.148	.257	.333	1.000
		Sig. (1-tailed)	.240	.107	.052	.
		N	25	25	25	25

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Tabel 4.10

Tabel Persamaan Regresi dan Uji t

Coefficients

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics	
		B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF
1	(Constant)	.053	.092		.578	.569		
	Price Earning Ratio	-.003	.002	-.286	-1.545	.137	.967	1.034
	Debt to Equity Ratio	.020	.014	.265	1.413	.172	.945	1.058
	Return On Equity	.004	.002	.383	2.067	.051	.968	1.034

a. Dependent Variable: Return Saham

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Lampiran 11

Tabel 4.11

Tabel Uji F

ANOVA^a

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	.375	3	.125	3.046	.051 ^a
	Residual	.863	21	.041		
	Total	1.238	24			

a. Predictors: (Constant), Return On Equity, Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio

b. Dependent Variable: Return Saham

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Tabel 4.12

Tabel Uji Koefisien Regresi R²

Model Summary

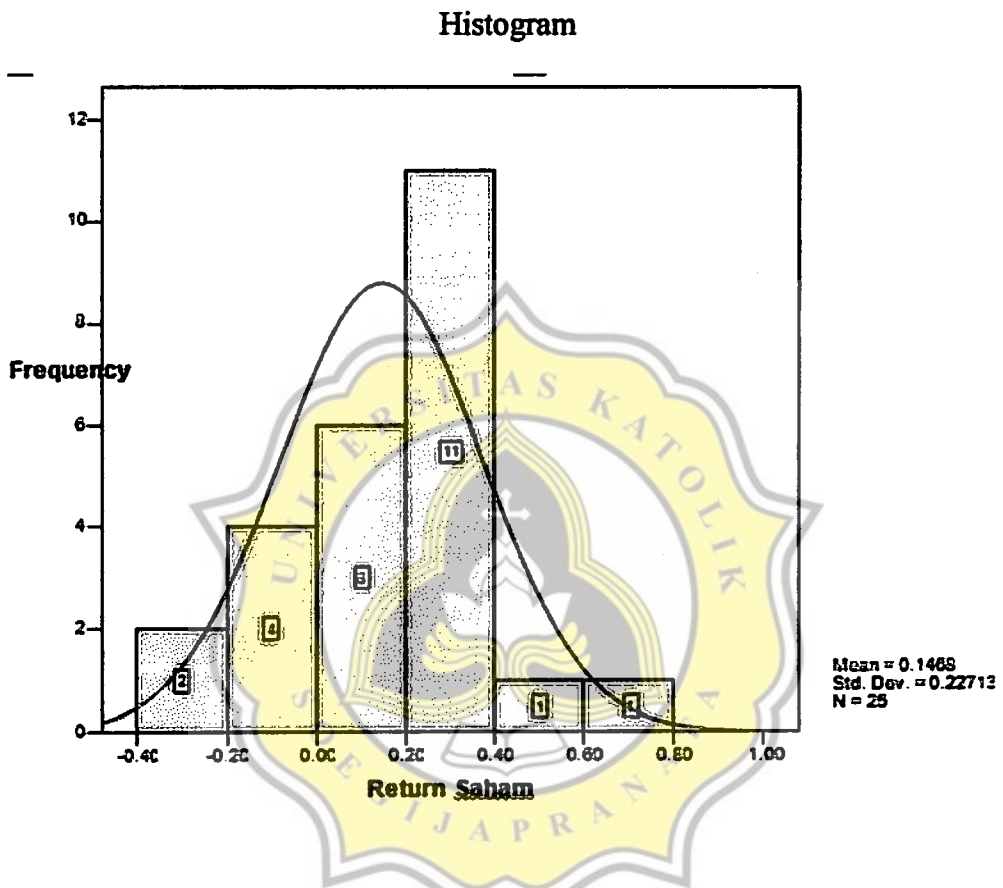
Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Change Statistics					Durbin-Watson
					R Square Change	F Change	df1	df2	sig. F Change	
1	.551 ^a	.303	.204	.20269	.303	3.046	3	21	.051	1.723

a. Predictors: (Constant), Return On Equity, Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio

b. Dependent Variable: Return Saham

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Lampiran 12

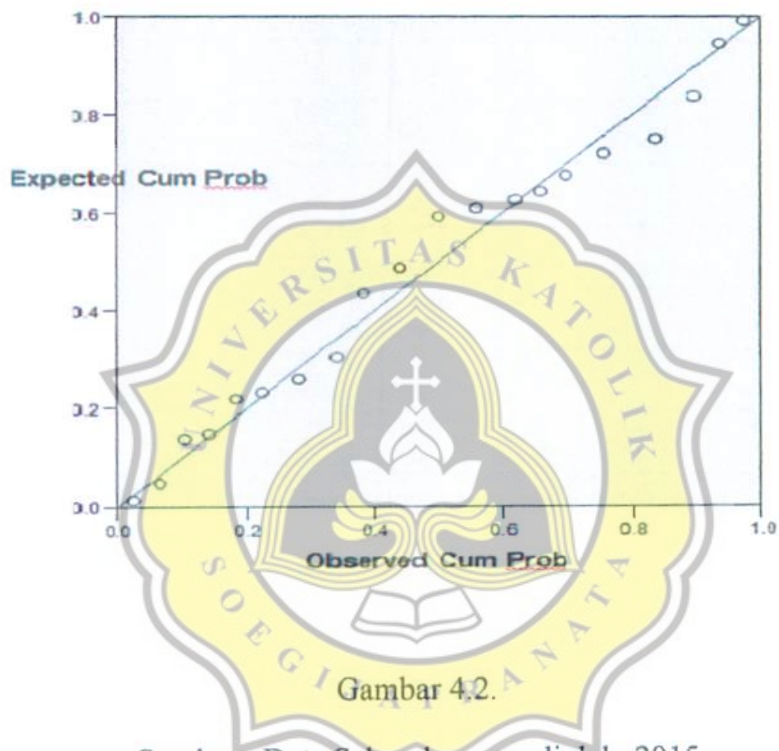


Gambar 4.1.

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015

Lampiran 13

Gambar Normal P-P PLOT

Normal P-P Plot of Return Saham

Gambar 4.2.

Sumber : Data Sekunder yang diolah, 2015