

Lampiran 1.
Indeks Saham Masing-Masing Saham Otomotif

ASII

AUTO

GJTL

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	2.485,44
2010	Januari	2.574,9750
2010	Februari	2.596,46
2010	Maret	3.001,153
2010	April	3377,193
2010	Mei	3090,686
2010	Juni	3459,563
2010	Juli	3631,467
2010	Agustus	3409,425
2010	September	4061,226
2010	Oktober	4082,714
2010	Nopember	3717,419
2010	Desember	3907,229
2011	Januari	3.502,539
2011	Februari	3.728,163
2011	Maret	4.082,714
2011	April	4.196,130
2011	Mei	4.208,061
2011	Juni	4.551,868
2011	Juli	5.049,673
2011	Agustus	4.738,097
2011	September	4.896,130
2011	Oktober	4.942,233
2011	Nopember	5.196,130
2011	Desember	5300,366

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	1000
2010	Januari	1.330,4350
2010	Februari	1.713,04
2010	Maret	2.134,783
2010	April	2513,043
2010	Mei	2.121,7390
2010	Juni	2269,565
2010	Juli	2782,609
2010	Agustus	2956,522
2010	September	3113,044
2010	Oktober	2991,304
2010	Nopember	2808,696
2010	Desember	2426,087
2011	Januari	2.191,304
2011	Februari	2.373,913
2011	Maret	2.400,000
2011	April	2.675,000
2011	Mei	2.800,000
2011	Juni	2.826,087
2011	Juli	3.413,043
2011	Agustus	3.239,130
2011	September	2.715,286
2011	Oktober	2.891,304
2011	Nopember	2.903,360
2011	Desember	2956,522

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	83,438
2010	Januari	90,3090
2010	Februari	111,905
2010	Maret	157,060
2010	April	204,178
2010	Mei	168,839
2010	Juni	190,435
2010	Juli	241,48
2010	Agustus	337,679
2010	September	388,723
2010	Oktober	456,455
2010	Nopember	451,547
2010	Desember	451,547
2011	Januari	446,639
2011	Februari	402,466
2011	Maret	436,823
2011	April	509,360
2011	Mei	584,066
2011	Juni	613,515
2011	Juli	642,964
2011	Agustus	569,342
2011	September	509,360
2011	Oktober	539,893
2011	Nopember	509,360
2011	Desember	588,974

Lampiran 1.
Indeks Saham Masing-Masing Saham Otomotif

GDYR

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	768
2010	Januari	896,0000
2010	Februari	983
2010	Maret	1.024,000
2010	April	1148
2010	Mei	1.040
2010	Juni	1000
2010	Juli	1040
2010	Agustus	1028
2010	September	1040
2010	Oktober	996
2010	Nopember	872
2010	Desember	1000
2011	Januari	780,000
2011	Februari	808,000
2011	Maret	816,000
2011	April	856,000
2011	Mei	968,000
2011	Juni	840,000
2011	Juli	820,000
2011	Agustus	752,000
2011	September	724,000
2011	Oktober	736,000
2011	Nopember	746,000
2011	Desember	764

BRAM

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	56,432
2010	Januari	62,3670
2010	Februari	65,268
2010	Maret	70,365
2010	April	72,36
2010	Mei	73,3655
2010	Juni	74,3695
2010	Juli	75,3698
2010	Agustus	78,365
2010	September	81,73
2010	Oktober	89,513
2010	Nopember	97,297
2010	Desember	93,405
2011	Januari	85,621
2011	Februari	99,243
2011	Maret	79,784
2011	April	81,450
2011	Mei	82,703
2011	Juni	95,351
2011	Juli	81,730
2011	Agustus	75,892
2011	September	83,368
2011	Oktober	89,513
2011	Nopember	85,621
2011	Desember	83,675

IMAS

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	157,376
2010	Januari	163,6980
2010	Februari	169,3697
2010	Maret	175,257
2010	April	198,325
2010	Mei	223,368
2010	Juni	259,2887
2010	Juli	296,387
2010	Agustus	345,3687
2010	September	424,689
2010	Oktober	463,676
2010	Nopember	467,012
2010	Desember	507,042
2011	Januari	446,997
2011	Februari	446,997
2011	Maret	500,370
2011	April	536,398
2011	Mei	573,758
2011	Juni	547,071
2011	Juli	698,369
2011	Agustus	751,803
2011	September	831,698
2011	Oktober	825,641
2011	Nopember	843,678
2011	Desember	859,203

Lampiran 1.
Indeks Saham Masing-Masing Saham Otomotif

INDS

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	13,889
2010	Januari	21,3600
2010	Februari	28,96
2010	Maret	31,111
2010	April	33,333
2010	Mei	31,111
2010	Juni	30
2010	Juli	36,111
2010	Agustus	52,778
2010	September	78,333
2010	Oktober	75
2010	Nopember	168,333
2010	Desember	116,667
2011	Januari	108,889
2011	Februari	100,000
2011	Maret	103,333
2011	April	90,000
2011	Mei	136,021
2011	Juni	195,161
2011	Juli	224,731
2011	Agustus	169,534
2011	September	155,389
2011	Oktober	145,878
2011	Nopember	139,640
2011	Desember	137,993

LPIN

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	25,131
2010	Januari	25,6980
2010	Februari	27,3978
2010	Maret	28,987
2010	April	30,36
2010	Mei	30,615
2010	Juni	38,154
2010	Juli	38,154
2010	Agustus	34,27
2010	September	51,405
2010	Oktober	58,83
2010	Nopember	73,109
2010	Desember	63,93
2011	Januari	59,401
2011	Februari	52,547
2011	Maret	57,688
2011	April	67,770
2011	Mei	75,965
2011	Juni	73,109
2011	Juli	72,538
2011	Agustus	62,828
2011	September	65,399
2011	Oktober	62,828
2011	Nopember	57,566
2011	Desember	50,263

MASA

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	145,762
2010	Januari	140,0740
2010	Februari	140,785
2010	Maret	188,424
2010	April	209,755
2010	Mei	181,314
2010	Juni	181,314
2010	Juli	188,424
2010	Agustus	184,869
2010	September	259,528
2010	Oktober	231,086
2010	Nopember	227,531
2010	Desember	234,642
2011	Januari	199,090
2011	Februari	195,535
2011	Maret	238,197
2011	April	293,380
2011	Mei	344,852
2011	Juni	398,180
2011	Juli	376,849
2011	Agustus	391,069
2011	September	378,970
2011	Oktober	369,738
2011	Nopember	358,554
2011	Desember	355,518

Lampiran 1.
Indeks Saham Masing-Masing Saham Otomotif

NIPS

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	29
2010	Januari	34,0000
2010	Februari	29
2010	Maret	34,000
2010	April	39,8
2010	Mei	39,8
2010	Juni	35
2010	Juli	32
2010	Agustus	39
2010	September	66,5
2010	Oktober	82
2010	Nopember	77
2010	Desember	79,5
2011	Januari	74,000
2011	Februari	77,500
2011	Maret	72,000
2011	April	71,000
2011	Mei	69,000
2011	Juni	61,000
2011	Juli	76,000
2011	Agustus	77,500
2011	September	81,000
2011	Oktober	84,000
2011	Nopember	83,000
2011	Desember	80

PRAS

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	66,993
2010	Januari	59,6750
2010	Februari	56,297
2010	Maret	58,549
2010	April	60,801
2010	Mei	52,356
2010	Juni	52,356
2010	Juli	54,608
2010	Agustus	55,171
2010	September	54,608
2010	Oktober	54,608
2010	Nopember	55,17
2010	Desember	52,355
2011	Januari	48,978
2011	Februari	42,222
2011	Maret	43,911
2011	April	52,390
2011	Mei	66,992
2011	Juni	68,681
2011	Juli	86,696
2011	Agustus	70,933
2011	September	77,366
2011	Oktober	70,933
2011	Nopember	71,178
2011	Desember	74,311

SMSM

Tahun	Bulan	Indeks
2009	Desember	500,835
2010	Januari	567,6130
2010	Februari	727,88
2010	Maret	861,436
2010	April	888,147
2010	Mei	627,713
2010	Juni	667,78
2010	Juli	607,68
2010	Agustus	520,868
2010	September	727,88
2010	Oktober	694,491
2010	Nopember	701,15
2010	Desember	714,505
2011	Januari	707,828
2011	Februari	861,413
2011	Maret	767,926
2011	April	789,561
2011	Mei	781,281
2011	Juni	801,314
2011	Juli	874,768
2011	Agustus	814,669
2011	September	836,398
2011	Oktober	874,768
2011	Nopember	879,156
2011	Desember	908,156

Lampiran 2.
Return Saham Masing-Masing Saham Otomotif

ASII

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	3,6023
2010	Februari	0,834494
2010	Maret	15,586
2010	April	12,52985
2010	Mei	-8,48358
2010	Juni	11,93512
2010	Juli	4,968951
2010	Agustus	-6,11439
2010	September	19,11762
2010	Oktober	0,529101
2010	Nopember	-8,94736
2010	Desember	5,105962
2011	Januari	-10,357
2011	Februari	6,442
2011	Maret	9,510
2011	April	2,778
2011	Mei	0,284
2011	Juni	8,170
2011	Juli	10,936
2011	Agustus	-6,170
2011	September	3,335
2011	Oktober	0,942
2011	Nopember	5,137
2011	Desember	2,006031

AUTO

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	33,0435
2010	Februari	28,75811
2010	Maret	24,619
2010	April	17,7189
2010	Mei	-15,5709
2010	Juni	6,967209
2010	Juli	22,60539
2010	Agustus	6,249998
2010	September	5,294126
2010	Oktober	-3,91064
2010	Nopember	-6,10463
2010	Desember	-13,6223
2011	Januari	-9,677
2011	Februari	8,333
2011	Maret	1,099
2011	April	11,458
2011	Mei	4,673
2011	Juni	0,932
2011	Juli	20,769
2011	Agustus	-5,096
2011	September	-16,172
2011	Oktober	6,482
2011	Nopember	0,417
2011	Desember	1,831051

GJTL

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	8,2349
2010	Februari	23,91345
2010	Maret	40,351
2010	April	30
2010	Mei	-17,3079
2010	Juni	12,79088
2010	Juli	26,80442
2010	Agustus	39,83725
2010	September	15,11613
2010	Oktober	17,42423
2010	Nopember	-1,07524
2010	Desember	0
2011	Januari	-1,087
2011	Februari	-9,890
2011	Maret	8,537
2011	April	16,606
2011	Mei	14,667
2011	Juni	5,042
2011	Juli	4,800
2011	Agustus	-11,450
2011	September	-10,535
2011	Oktober	5,994
2011	Nopember	-5,655
2011	Desember	15,6302

Lampiran 2.
Return Saham Masing-Masing Saham Otomotif

GDYR

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	16,6667
2010	Februari	9,709821
2010	Maret	4,171
2010	April	12,10938
2010	Mei	-9,40767
2010	Juni	-3,84615
2010	Juli	4
2010	Agustus	-1,15385
2010	September	1,167315
2010	Oktober	-4,23077
2010	Nopember	-12,4498
2010	Desember	14,6789
2011	Januari	-22,000
2011	Februari	3,590
2011	Maret	0,990
2011	April	4,902
2011	Mei	13,084
2011	Juni	-13,223
2011	Juli	-2,381
2011	Agustus	-8,293
2011	September	-3,723
2011	Oktober	1,657
2011	Nopember	1,359
2011	Desember	2,412869

BRAM

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	10,5171
2010	Februari	4,651498
2010	Maret	7,809
2010	April	2,835947
2010	Mei	1,38958
2010	Juni	1,368491
2010	Juli	1,345041
2010	Agustus	3,974006
2010	September	4,294009
2010	Oktober	9,522819
2010	Nopember	8,695944
2010	Desember	-4,00012
2011	Januari	-8,334
2011	Februari	15,910
2011	Maret	-19,607
2011	April	2,088
2011	Mei	1,538
2011	Juni	15,293
2011	Juli	-14,285
2011	Agustus	-7,143
2011	September	9,851
2011	Oktober	7,371
2011	Nopember	-4,348
2011	Desember	-2,27281

IMAS

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	4,0171
2010	Februari	3,464734
2010	Maret	3,476
2010	April	13,16238
2010	Mei	12,62725
2010	Juni	16,0814
2010	Juli	14,30772
2010	Agustus	16,52626
2010	September	22,96685
2010	Oktober	9,180129
2010	Nopember	0,719468
2010	Desember	8,571514
2011	Januari	-11,842
2011	Februari	0,000
2011	Maret	11,940
2011	April	7,200
2011	Mei	6,965
2011	Juni	-4,651
2011	Juli	27,656
2011	Agustus	7,651
2011	September	10,627
2011	Oktober	-0,728
2011	Nopember	2,185
2011	Desember	1,840157

Lampiran 2.
Return Saham Masing-Masing Saham Otomotif

INDS

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	53,7908
2010	Februari	35,58052
2010	Maret	7,427
2010	April	7,142168
2010	Mei	-6,66607
2010	Juni	-3,57108
2010	Juli	20,37
2010	Agustus	46,15491
2010	September	48,4198
2010	Oktober	-4,25491
2010	Nopember	124,444
2010	Desember	-30,6927
2011	Januari	-6,667
2011	Februari	-8,163
2011	Maret	3,333
2011	April	-12,903
2011	Mei	51,134
2011	Juni	43,479
2011	Juli	15,152
2011	Agustus	-24,561
2011	September	-8,343
2011	Oktober	-6,121
2011	Nopember	-4,276
2011	Desember	-1,17946

LPIN

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	2,2562
2010	Februari	6,614523
2010	Maret	5,800
2010	April	4,736606
2010	Mei	0,839921
2010	Juni	24,62518
2010	Juli	0
2010	Agustus	-10,1798
2010	September	50
2010	Oktober	14,44412
2010	Nopember	24,27163
2010	Desember	-12,5552
2011	Januari	-7,084
2011	Februari	-11,539
2011	Maret	9,784
2011	April	17,477
2011	Mei	12,092
2011	Juni	-3,760
2011	Juli	-0,781
2011	Agustus	-13,386
2011	September	4,092
2011	Oktober	-3,931
2011	Nopember	-8,375
2011	Desember	-12,6863

MASA

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	-3,9023
2010	Februari	0,507589
2010	Maret	33,838
2010	April	11,32074
2010	Mei	-13,5592
2010	Juni	0
2010	Juli	3,921374
2010	Agustus	-1,8867
2010	September	40,38481
2010	Oktober	-10,9591
2010	Nopember	-1,53839
2010	Desember	3,125288
2011	Januari	-15,152
2011	Februari	-1,786
2011	Maret	21,818
2011	April	23,167
2011	Mei	17,544
2011	Juni	15,464
2011	Juli	-5,357
2011	Agustus	3,773
2011	September	-3,094
2011	Oktober	-2,436
2011	Nopember	-3,025
2011	Desember	-0,84673

Lampiran 2.
Return Saham Masing-Masing Saham Otomotif

NIPS

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	17,2414
2010	Februari	-14,7059
2010	Maret	17,241
2010	April	17,05882
2010	Mei	0
2010	Juni	-12,0603
2010	Juli	-8,57143
2010	Agustus	21,875
2010	September	70,51282
2010	Oktober	23,30827
2010	Nopember	-6,09756
2010	Desember	3,246753
2011	Januari	-6,918
2011	Februari	4,730
2011	Maret	-7,097
2011	April	-1,389
2011	Mei	-2,817
2011	Juni	-11,594
2011	Juli	24,590
2011	Agustus	1,974
2011	September	4,516
2011	Oktober	3,704
2011	Nopember	-1,190
2011	Desember	-3,61446

PRAS

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	-10,9235
2010	Februari	-5,66066
2010	Maret	4,000
2010	April	3,846351
2010	Mei	-13,8896
2010	Juni	0
2010	Juli	4,301322
2010	Agustus	1,030984
2010	September	-1,02046
2010	Oktober	0
2010	Nopember	1,029153
2010	Desember	-5,10241
2011	Januari	-6,450
2011	Februari	-13,794
2011	Maret	4,000
2011	April	19,310
2011	Mei	27,872
2011	Juni	2,521
2011	Juli	26,230
2011	Agustus	-18,182
2011	September	9,069
2011	Oktober	-8,315
2011	Nopember	0,345
2011	Desember	4,401641

SMSM

Tahun	Bulan	Return
2010	Januari	13,3333
2010	Februari	28,23526
2010	Maret	18,349
2010	April	3,100753
2010	Mei	-29,3233
2010	Juni	6,383013
2010	Juli	-8,99997
2010	Agustus	-14,2858
2010	September	39,74366
2010	Oktober	-4,58716
2010	Nopember	0,958832
2010	Desember	1,904728
2011	Januari	-0,934
2011	Februari	21,698
2011	Maret	-10,853
2011	April	2,817
2011	Mei	-1,049
2011	Juni	2,564
2011	Juli	9,167
2011	Agustus	-6,870
2011	September	2,667
2011	Oktober	4,588
2011	Nopember	0,502
2011	Desember	3,298618

Lampiran 3.
Suku Bunga Bebas Risiko (SBI)

Tahun	Bulan	SBI
2010	Januari	0,536666667
2010	Februari	0,534166667
2010	Maret	0,5225
2010	April	0,516666667
2010	Mei	0,525
2010	Juni	0,55
2010	Juli	0,5525
2010	Agustus	0,503333333
2010	September	0,5025
2010	Oktober	0,501666667
2010	Nopember	0,503333333
2010	Desember	0,504166667
2011	Januari	0,504166667
2011	Februari	0,505
2011	Maret	0,506666667
2011	April	0,506666667
2011	Mei	0,501666667
2011	Juni	0,5025
2011	Juli	0,500833333
2011	Agustus	0,500833333
2011	September	0,4975
2011	Oktober	0,530805833
2011	Nopember	0,535271667
2011	Desember	0,521850833

Lampiran 4.
Perhitungan *Return Market*

Tahun	Bulan	IHSG	Rm
2009	Desember	2534,356	
2010	Januari	2610,796	3,016151
2010	Februari	2549,033	-2,36568
2010	Maret	2777,301	8,955082
2010	April	2971,252	6,983435
2010	Mei	2796,957	-5,86605
2010	Juni	2913,684	4,173357
2010	Juli	3069,28	5,340181
2010	Agustus	3081,884	0,41065
2010	September	3501,296	13,60895
2010	Oktober	3635,324	3,827954
2010	Nopember	3531,211	-2,86393
2010	Desember	3703,512	4,879374
2011	Januari	3409,167	-7,94773
2011	Februari	3470,348	1,794603
2011	Maret	3678,674	6,003029
2011	April	3819,618	3,831381
2011	Mei	3836,967	0,454208
2011	Juni	3888,569	1,344864
2011	Juli	4130,8	6,22931
2011	Agustus	3841,731	-6,99789
2011	September	3549,032	-7,61894
2011	Oktober	3790,847	6,813548
2011	Nopember	3715,08	-1,99868
2011	Desember	3821,992	2,877785

Lampiran 5.
Small Minus Big

Tahun	Bulan	SMB
2010	Januari	39,93621
2010	Februari	4,443654
2010	Maret	0,696123
2010	April	14,23238
2010	Mei	-2,64094
2010	Juni	-7,92938
2010	Juli	0,174079
2010	Agustus	41,35767
2010	September	143,9398
2010	Oktober	39,99028
2010	Nopember	158,7684
2010	Desember	-38,067
2011	Januari	-30,1448
2011	Februari	-17,7269
2011	Maret	-22,946
2011	April	9,026837
2011	Mei	99,82213
2011	Juni	24,32472
2011	Juli	32,40535
2011	Agustus	-71,213
2011	September	-6,81084
2011	Oktober	-8,63963
2011	Nopember	-15,896
2011	Desember	-18,2906

Lampiran 6.
Book to Market Ratio

Tahun	Bulan	HML
2010	Januari	-20,9504
2010	Februari	-18,1603
2010	Maret	-28,1971
2010	April	-26,8187
2010	Mei	15,95522
2010	Juni	-9,44964
2010	Juli	-13,9952
2010	Agustus	-22,5394
2010	September	-91,3175
2010	Oktober	-11,7761
2010	Nopember	-28,2621
2010	Desember	6,312868
2011	Januari	21,75093
2011	Februari	-3,70584
2011	Maret	-7,85998
2011	April	-24,1
2011	Mei	-36,6611
2011	Juni	-12,9428
2011	Juli	-36,7339
2011	Agustus	24,12929
2011	September	-0,51946
2011	Oktober	-2,00744
2011	Nopember	4,019215
2011	Desember	-2,0336

Lampiran 7.
Standar Deviasi

Kode Saham	Nama Perusahaan	Standar Deviasi
ASII.JK	Astra International Tbk.	7,757473
AUTO.JK	Astra Otoparts Tbk.	13,69355
GJTL.JK	Gajah Tunggal Tbk.	15,54111
GDYR.JK	Goodyear Indonesia Tbk.	9,346272
BRAM.JK	Indo Kordsa Tbk.	8,606623
IMAS.JK	Indomobil Sukses Internasional Tbk.	8,685605
INDS.JK	Indospring Tbk.	34,02247
LPIN.JK	Multi Prima Sejahtera Tbk.	14,8916
MASA.JK	Multistrada Arah Sarana Tbk.	14,1406
NIPS.JK	Nipress Tbk.	18,10214
PRAS.JK	Prima Alloy Steel Tbk.	11,40353
SMSM.JK	Selamat Sempurna Tbk.	14,14946

Lampiran 8.
Premium Return Masing-Masing Saham Otomotif

ASII

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	0,395184145
2010	Februari	0,038714525
2010	Maret	1,941831284
2010	April	1,548595114
2010	Mei	-1,161278185
2010	Juni	1,467632271
2010	Juli	0,569315734
2010	Agustus	-0,853077033
2010	September	2,399637501
2010	Oktober	0,003536544
2010	Nopember	-1,218269241
2010	Desember	0,593208053
2011	Januari	-1,400151211
2011	Februari	0,765291377
2011	Maret	1,160610683
2011	April	0,292787284
2011	Mei	-0,028015986
2011	Juni	0,988427581
2011	Juli	1,345212079
2011	Agustus	-0,85995206
2011	September	0,365823859
2011	Oktober	0,052957377
2011	Nopember	0,593237218
2011	Desember	0,191322694

AUTO

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	2,373879857
2010	Februari	2,061113025
2010	Maret	1,75972292
2010	April	1,256229039
2010	Mei	-1,17543865
2010	Juni	0,468630213
2010	Juli	1,610458601
2010	Agustus	0,419662253
2010	September	0,349918564
2010	Oktober	-0,322218104
2010	Nopember	-0,482560316
2010	Desember	-1,031614945
2011	Januari	-0,743532894
2011	Februari	0,571681613
2011	Maret	0,0432493
2011	April	0,799768487
2011	Mei	0,30461288
2011	Juni	0,031341668
2011	Juli	1,48014097
2011	Agustus	-0,408686992
2011	September	-1,21735211
2011	Oktober	0,434633865
2011	Nopember	-0,0086389
2011	Desember	0,095607089

Lampiran 8.
Premium Return Masing-Masing Saham Otomotif

GJTL

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	0,495343706
2010	Februari	1,504351238
2010	Maret	2,562795978
2010	April	1,897119054
2010	Mei	-1,147468793
2010	Juni	0,787645457
2010	Juli	1,689192325
2010	Agustus	2,530959737
2010	September	0,940321011
2010	Oktober	1,088890529
2010	Nopember	-0,101574236
2010	Desember	-0,032440843
2011	Januari	-0,102379872
2011	Februari	-0,668877005
2011	Maret	0,516691263
2011	April	1,035892314
2011	Mei	0,911451952
2011	Juni	0,2921006
2011	Juli	0,276634853
2011	Agustus	-0,769008274
2011	September	-0,709912013
2011	Oktober	0,351556597
2011	Nopember	-0,398340406
2011	Desember	0,972154054

GDYR

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	1,725821808
2010	Februari	0,981744891
2010	Maret	0,390359429
2010	April	1,240356408
2010	Mei	-1,062740902
2010	Juni	-0,470364425
2010	Juli	0,368863651
2010	Agustus	-0,177309144
2010	September	0,071131589
2010	Oktober	-0,506344766
2010	Nopember	-1,385914359
2010	Desember	1,516618867
2011	Januari	-2,407822791
2011	Februari	0,330050698
2011	Maret	0,051724618
2011	April	0,470272439
2011	Mei	1,346252871
2011	Juni	-1,468568487
2011	Juli	-0,308335315
2011	Agustus	-0,940858161
2011	September	-0,451613677
2011	Oktober	0,120545682
2011	Nopember	0,088101864
2011	Desember	0,202328565

Lampiran 8.
Premium Return Masing-Masing Saham Otomotif

BRAM

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	1,15962046
2010	Februari	0,478391099
2010	Maret	0,846565963
2010	April	0,269476251
2010	Mei	0,100455185
2010	Juni	0,095100095
2010	Juli	0,092084975
2010	Agustus	0,403255989
2010	September	0,440533867
2010	Oktober	1,048164028
2010	Nopember	0,951896058
2010	Desember	-0,523351625
2011	Januari	-1,026856632
2011	Februari	1,789859829
2011	Maret	-2,337048512
2011	April	0,183750508
2011	Mei	0,120453802
2011	Juni	1,718534526
2011	Juli	-1,717973327
2011	Agustus	-0,888137599
2011	September	1,086760851
2011	Oktober	0,794751676
2011	Nopember	-0,567382074
2011	Desember	-0,324710147

IMAS

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	0,400716412
2010	Februari	0,337405089
2010	Maret	0,340046043
2010	April	1,455939845
2010	Mei	1,393369132
2010	Juni	1,788177121
2010	Juli	1,583680157
2010	Agustus	1,844768693
2010	September	2,586388392
2010	Oktober	0,99917775
2010	Nopember	0,024884229
2010	Desember	0,928818199
2011	Januari	-1,421476292
2011	Februari	-0,058142182
2011	Maret	1,316394488
2011	April	0,770655066
2011	Mei	0,744140584
2011	Juni	-0,593368499
2011	Juli	3,126457653
2011	Agustus	0,823249854
2011	September	1,166253775
2011	Oktober	-0,144961123
2011	Nopember	0,189892826
2011	Desember	0,151780592

Lampiran 8.
Premium Return Masing-Masing Saham Otomotif

INDS

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	1,565262795
2010	Februari	1,030094522
2010	Maret	0,202953714
2010	April	0,19473901
2010	Mei	-0,211362289
2010	Juni	-0,121128315
2010	Juli	0,582482732
2010	Agustus	1,341806779
2010	September	1,408401543
2010	Oktober	-0,139806978
2010	Nopember	3,64290643
2010	Desember	-0,916949967
2011	Januari	-0,210772623
2011	Februari	-0,254783371
2011	Maret	0,083072555
2011	April	-0,394139884
2011	Mei	1,488215908
2011	Juni	1,263167645
2011	Juli	0,430620129
2011	Agustus	-0,736636683
2011	September	-0,259856492
2011	Oktober	-0,195505328
2011	Nopember	-0,141419714
2011	Desember	-0,050005553

LPIN

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	0,115468516
2010	Februari	0,408307759
2010	Maret	0,354425696
2010	April	0,283377164
2010	Mei	0,021147556
2010	Juni	1,616695558
2010	Juli	-0,037101453
2010	Agustus	-0,717393089
2010	September	3,323853693
2010	Oktober	0,936262957
2010	Nopember	1,5960875
2010	Desember	-0,87696368
2011	Januari	-0,509581078
2011	Februari	-0,808746287
2011	Maret	0,622965669
2011	April	1,139575654
2011	Mei	0,778338426
2011	Juni	-0,286210086
2011	Juli	-0,086079328
2011	Agustus	-0,932533813
2011	September	0,24138605
2011	Oktober	-0,299635941
2011	Nopember	-0,598358693
2011	Desember	-0,886953627

Lampiran 8.
Premium Return Masing-Masing Saham Otomotif

MASA		
Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	-0,313913039
2010	Februari	-0,00187954
2010	Maret	2,35602628
2010	April	0,764046723
2010	Mei	-0,996008212
2010	Juni	-0,0388951
2010	Juli	0,238241256
2010	Agustus	-0,169019412
2010	September	2,82041193
2010	Oktober	-0,810488493
2010	Nopember	-0,144387214
2010	Desember	0,185361442
2011	Januari	-1,107149685
2011	Februari	-0,161989224
2011	Maret	1,50710891
2011	April	1,602498762
2011	Mei	1,205239987
2011	Juni	1,058054581
2011	Juli	-0,414265224
2011	Agustus	0,231430182
2011	September	-0,253972801
2011	Oktober	-0,209813081
2011	Nopember	-0,251765599
2011	Desember	-0,096784107

NIPS		
Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	0,92280316
2010	Februari	-0,841892087
2010	Maret	0,923585756
2010	April	0,913823239
2010	Mei	-0,029002095
2010	Juni	-0,696619351
2010	Juli	-0,50402484
2010	Agustus	1,180615432
2010	September	3,867516093
2010	Oktober	1,259884363
2010	Nopember	-0,364647166
2010	Desember	0,151506202
2011	Januari	-0,410029166
2011	Februari	0,23338288
2011	Maret	-0,420029928
2011	April	-0,104714442
2011	Mei	-0,18332462
2011	Juni	-0,668247093
2011	Juli	1,330744854
2011	Agustus	0,081363354
2011	September	0,221997448
2011	Oktober	0,175277495
2011	Nopember	-0,09533391
2011	Desember	-0,228498316

Lampiran 8.
Premium Return Masing-Masing Saham Otomotif

PRAS

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	-1,004969224
2010	Februari	-0,543237836
2010	Maret	0,304968143
2010	April	0,29198717
2010	Mei	-1,264044999
2010	Juni	-0,048230682
2010	Juli	0,328742236
2010	Agustus	0,046270863
2010	September	-0,133551957
2010	Oktober	-0,043992228
2010	Nopember	0,046110278
2010	Desember	-0,491652825
2011	Januari	-0,609842993
2011	Februari	-1,253905517
2011	Maret	0,306362833
2011	April	1,648861967
2011	Mei	2,400139803
2011	Juni	0,177023841
2011	Juli	2,25624258
2011	Agustus	-1,638331071
2011	September	0,751663922
2011	Oktober	-0,775709669
2011	Nopember	-0,016650574
2011	Desember	0,340227137

SMSM

Tahun	Bulan	<i>Premium Return</i>
2010	Januari	0,904392716
2010	Februari	1,957749365
2010	Maret	1,259845361
2010	April	0,182627917
2010	Mei	-2,109501238
2010	Juni	0,412242834
2010	Juli	-0,675112087
2010	Agustus	-1,045209064
2010	September	2,773333009
2010	Oktober	-0,359647976
2010	Nopember	0,032191932
2010	Desember	0,098983388
2011	Januari	-0,101675964
2011	Februari	1,497800696
2011	Maret	-0,802816392
2011	April	0,16330393
2011	Mei	-0,109569617
2011	Juni	0,145703268
2011	Juli	0,612451758
2011	Agustus	-0,520946607
2011	September	0,153342851
2011	Oktober	0,286705194
2011	Nopember	-0,002378392
2011	Desember	0,196245496

Lampiran 9.
 Hasil Regresi Pengaruh *Return Market*, *Size* dan *Book to Market Ratio*
 Terhadap *Premium Return*

Model Summary^b

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	.525 ^a	.275	.267	.859562394	.275	35.933	3	284	.000	2.059

a. Predictors: (Constant), book_to_market, return_market, size

b. Dependent Variable: premium_return

ANOVA^b

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	79.647	3	26.549	35.933	.000 ^a
	Residual	209.833	284	.739		
	Total	289.480	287			

a. Predictors: (Constant), book_to_market, return_market, size

b. Dependent Variable: premium_return

Lampiran 9.
 Hasil Regresi Pengaruh *Return Market*, *Size* dan *Book to Market Ratio*
 Terhadap *Premium Return*

Coefficients^a

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics	
		B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF
1	(Constant)	-.010	.064		-.155	.877		
	return_market	.009	.016	.049	.582	.561	.361	2.767
	size	-.003	.002	-.182	-1.793	.074	.248	4.038
	book_to_market	-.027	.006	-.618	-4.667	.000	.146	6.872

a. Dependent Variable: premium_return

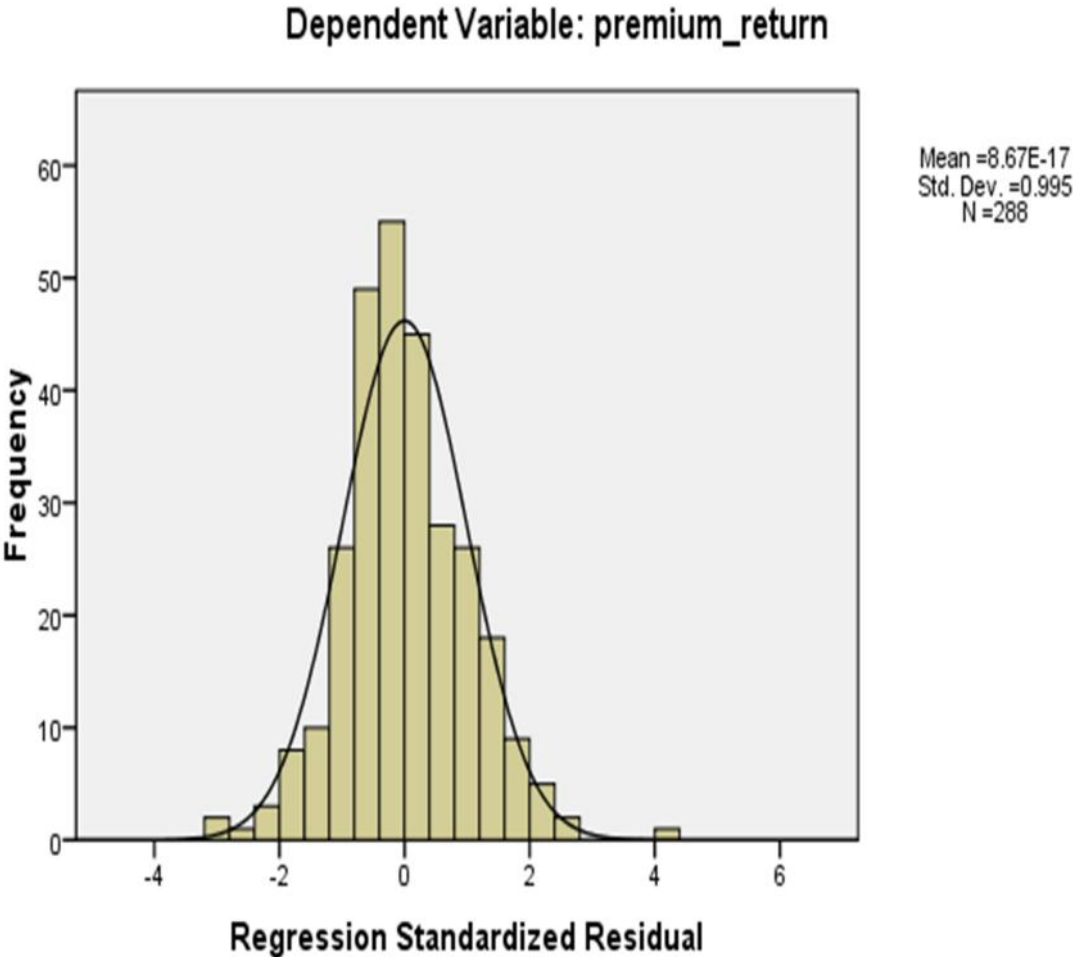
One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test

		Unstandardized Residual
N		288
Normal Parameters ^a	Mean	.0000000
	Std. Deviation	.85505811
Most Extreme Differences	Absolute	.064
	Positive	.064
	Negative	-.046
Kolmogorov-Smirnov Z		1.080
Asymp. Sig. (2-tailed)		.194
a. Test distribution is Normal.		

Lampiran 9.
Hasil Regresi Pengaruh *Return Market*, *Size* dan *Book to Market Ratio*
Terhadap *Premium Return*

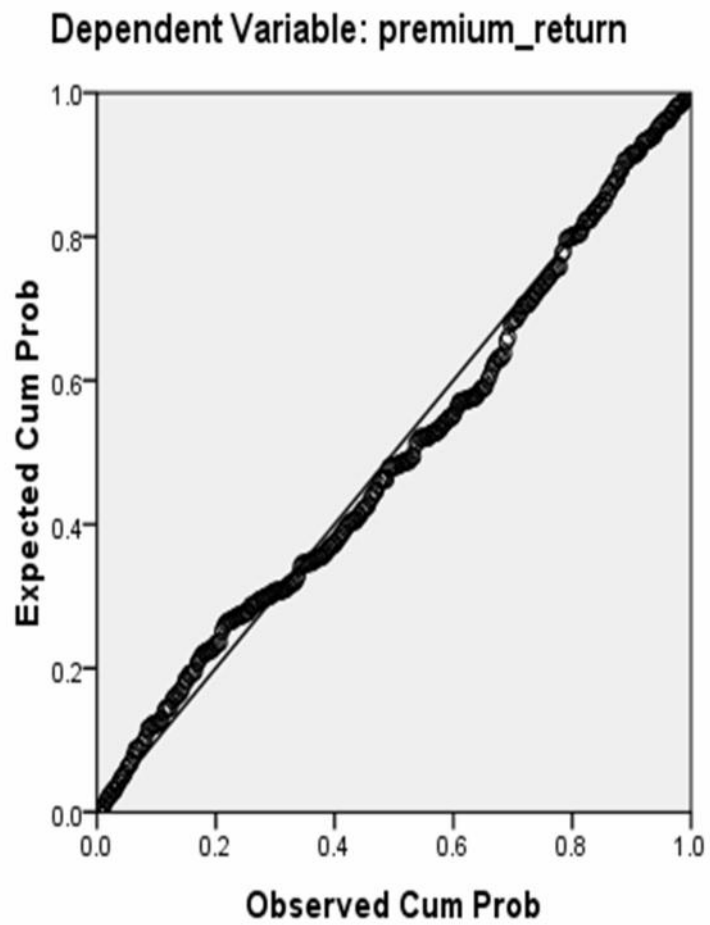
Charts

Histogram



Lampiran 9.
Hasil Regresi Pengaruh *Return Market*, *Size* dan *Book to Market Ratio*
Terhadap *Premium Return*

Normal P-P Plot of Regression Standardized Residual



Lampiran 9.
Hasil Regresi Pengaruh *Return Market*, *Size* dan *Book to Market Ratio*
Terhadap *Premium Return*

Scatterplot

