



LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Penelitian

Perusahaan	Bulan	Return Saham	Harga Saham	Bi Rate	Kurs	Inflasi
ANTM	Apr-20	-0,084313725	25	0	-424	-0,0048
	May-20	0,081821513	70	-0,0025	-431	-0,0023
	Jun-20	0,075770449	125	-0,0025	351	-0,0042
	Jul-20	-0,083323899	90	0	-99	-0,0022
	Aug-20	-0,263531573	-115	0	364	0,001
	Sep-20	0,636697803	350	0	-228	0,0002
	Oct-20	-0,411145844	90	-0,0025	-562	0,0015
	Nov-20	0,604648275	790	0	-23	0,0009
	Dec-20	-0,54266951	285	0	-21	-0,0012
	Jan-21	0,131992457	620	-0,0025	145	-0,0018
	Feb-21	-0,487025758	-590	0	343	-1E-04
	Mar-21	0,314413146	240	0	-104	0,0005
ADRO	Apr-21	-0,122730924	-40	0	-158	0,0026
	May-21	-0,054642814	-1530	0,01	847	-0,0048
	Apr-20	0,266359245	180	0	-424	-0,0023
	May-20	-0,291106719	-105	-0,0025	-431	-0,0042
	Jun-20	0,185906806	90	-0,0025	351	-0,0022
	Jul-20	-0,090452261	0	0	-99	0,001
	Aug-20	0,046082949	50	0	364	0,0002
	Sep-20	-0,054893522	-10	0	-228	0,0015
	Oct-20	0,244366129	265	-0,0025	-562	0,0009
	Nov-20	-0,206778578	40	0	-23	-0,0012
	Dec-20	-0,189616139	-230	0	-21	-0,0018
	Jan-21	0,144172494	-20	-0,0025	145	-1E-04
INCO.JK	Feb-21	0,012429379	-5	0	343	0,0005
	Mar-21	0,063811756	70	0	-104	0,0026
	Apr-21	-0,103751175	-55	0	-158	0,0099
	May-21	0,233991522	1380	0,01	847	-0,0048
	Apr-20	-0,074517817	210	0	-424	-0,0048
	May-20	0,214234326	20	-0,0025	-431	-0,0023
	Jun-20	-0,113241436	620	-0,0025	351	-0,0042
	Jul-20	-0,168873151	370	0	-99	-0,0022
	Aug-20	0,198326465	-230	0	364	0,001
	Sep-20	0,000631156	490	0	-228	0,0002
	Oct-20	-0,031980933	560	-0,0025	-562	0,0015
	Nov-20	-0,027859299	490	0	-23	0,0009
Dec-20	0,026114082	400	0	-21	-0,0012	
Jan-21	-0,383557801	575	-0,0025	145	-0,0018	
Feb-21	0,331523762	-1695	0	343	-1E-04	
Mar-21	-0,026481047	230	0	-104	0,0005	

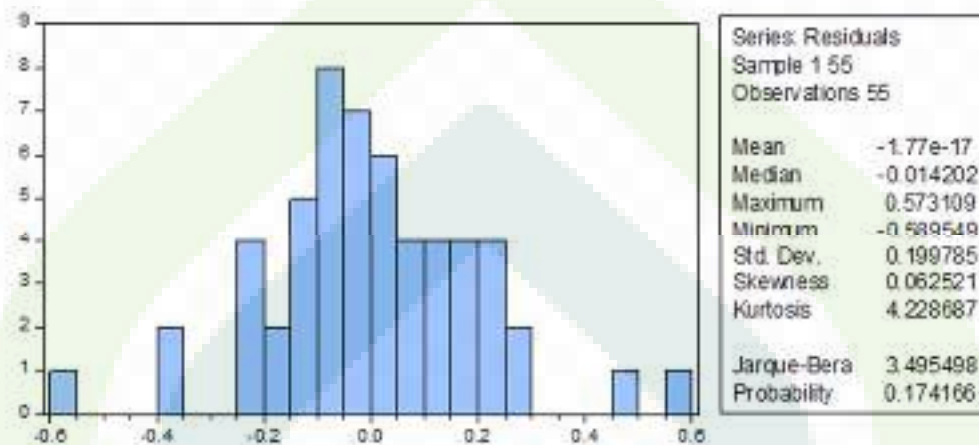
	Apr-21	-0,165938626	120	0	-158	0,0026
	May-21	-0,074517817	-2855	0,01	847	0,0099
PTBA.JK	Apr-20	0,17724159	70	0	-424	-0,0048
	May-20	0,001227078	75	-0,0025	-431	-0,0023
	Jun-20	-0,033609916	10	-0,0025	351	-0,0042
	Jul-20	-2,4387E-05	10	0	-99	-0,0022
	Aug-20	-0,039239833	-70	0	364	0,001
	Sep-20	0,029237583	-10	0	-228	0,0002
	Oct-20	0,209157775	400	-0,0025	-562	0,0015
	Nov-20	-0,013403667	450	0	-23	0,0009
	Dec-20	-0,2725285	-230	0	-21	-0,0012
	Jan-21	0,132238131	130	-0,0025	145	-0,0018
	Feb-21	-0,083597929	-90	0	343	-1E-04
	Mar-21	-0,062209515	-250	0	-104	0,0005
	Apr-21	0,027909298	-160	0	-158	0,0026

Lampiran 2. Uji Statistik Deskriptif

Date: 06/2021
Time: 22:01
Sample: 1 55

	RETURN	MARKET-MAD	RISKY	RURE	INFLAT
Mean	-0.000000	0.000000	-1.000000	-0.000000	-1.000000
Median	-0.000000	0.000000	0.000000	-0.000000	-1.000000
Maximum	0.000000	1.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Minimum	-0.000000	-1.000000	-0.000000	-0.000000	-0.000000
Std. Dev.	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Skewness	0.000000	-0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Kurtosis	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Jarque-Bera	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Probability	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Sum	-0.000000	0.000000	-0.000000	-0.000000	-0.000000
Sum Sq. Dev.	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
Observations	55	55	55	55	55

Lampiran 3. Uji Asumsi Klasik



Variable: RESID
Date: 10/04/21 Time: 21:43
Sample: 1 55
Included observations: 55

Variable	Coefficient	Unadjusted R ²	Adjusted R ²
C	0.000786	1.005209	NA
INFLASIKAN	2.78E-09	1.263356	1.365967
BIJAK	3.38E-06	3.142196	3.127115
INFLAS	8.73E-06	1.545740	1.542769
INFLAS1	1.89E-06	2.408649	2.458409

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:

F-statistic	1.292789	Prob. F(4,46)	0.2868
Obs*R-squared	5.558083	Prob. Chi-Square(4)	0.2347

Test Equation:

Dependent Variable: RESID
Method: Least Squares
Date: 10/04/21 Time: 21:13
Sample: 1 55
Included observations: 55
Presample missing value lagged residuals set to zero.

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
----------	-------------	------------	-------------	-------

C	0.076281	1.112583	0.068562	0.9456
HARGASAHAM	-1.25E-05	1.82E-05	-0.685402	0.4965
BIRATE	1.118239	6.776326	0.165021	0.8697
KURS	-6.32E-06	7.21E-05	-0.087547	0.9306
INFLASI	5.63E-06	0.000600	0.009383	0.9926
RESID(-1)	0.100499	0.158180	0.635344	0.5284
RESID(-2)	0.023467	0.147679	0.158907	0.8744
RESID(-3)	-0.327384	0.155576	-2.104332	0.0408
RESID(-4)	0.093735	0.167429	0.559850	0.5783

R-squared	0.101056	Mean dependent var	-9.16E-17
Adjusted R-squared	-0.055282	S.D. dependent var	0.153914
S.E. of regression	0.158111	Akaike info criterion	-0.702459
Sum squared resid	1.149957	Schwarz criterion	-0.373986
Log likelihood	28.31763	Hannan-Quinn criter.	-0.575436
F-statistic	0.646394	Durbin-Watson stat	1.957068
Prob(F-statistic)	0.734705		

Heteroskedasticity Test: Breusch-Pagan-Godfrey

F-statistic	0.295629	Prob. F(4,50)	0.8794
Obs*R-squared	1.270714	Prob. Chi-Square(4)	0.8663
Scaled explained SS	1.695346	Prob. Chi-Square(4)	0.7916

Test Equation:

Dependent Variable: RESID^2

Method: Least Squares

Date: 09/25/21 Time: 22:04

Sample: 1 55

Included observations: 55

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.039083	0.009868	3.960487	0.0002
HARGASAHAM	1.32E-05	1.86E-05	0.711631	0.4800
BIRATE	0.000249	0.000647	0.385341	0.7016
KURS	-2.27E-05	3.47E-05	-0.656063	0.5148
INFLASI	0.000111	0.000484	0.229612	0.8193

R-squared	0.023104	Mean dependent var	0.039188
Adjusted R-squared	-0.055048	S.D. dependent var	0.071065
S.E. of regression	0.072995	Akaike info criterion	-2.310356
Sum squared resid	0.266410	Schwarz criterion	-2.127871
Log likelihood	68.53480	Hannan-Quinn criter.	-2.239788
F-statistic	0.295629	Durbin-Watson stat	1.148648
Prob(F-statistic)	0.879439		

Lampiran 4. Regresi Linier Berganda

Dependent Variable: RETURN
 Method: Least Squares
 Date: 09/25/21 Time: 22:00
 Sample: 1 55
 Included observations: 55

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.006888	0.028069	-0.245385	0.8072
HARGASAHAM	0.000191	5.28E-05	3.616803	0.0007
BIRATE	0.001516	0.001840	0.823942	0.4139
KURS	-1.54E-05	9.86E-05	-0.155679	0.8769
INFLASI	8.02E-05	0.001377	0.058215	0.9538
R-squared	0.215543	Mean dependent var		-0.003652
Adjusted R-squared	0.152786	S.D. dependent var		0.225568
S.E. of regression	0.207623	Akaike info criterion		-0.219681
Sum squared resid	2.155359	Schwarz criterion		-0.037196
Log likelihood	11.04122	Hannan-Quinn criter.		-0.149113
F-statistic	3.434588	Durbin-Watson stat		3.059204
Prob(F-statistic)	0.014779			

Lampiran 5.

RIWAYAT HIDUP PENULIS


A. IDENTITAS

1. Nama : Annisa Dhiyaa Firdaus
2. Tempat Tanggal Lahir : Pekalongan, 8 September 1999
3. Alamat Rumah : Jl. Teratai Klego Gg 4 Pekalongan Timur
4. Nomer Handphone : 081567872146
5. Email : anisadiyafirda@gmail.com
6. Nama Ayah : Mohidin
7. Pekerjaan Ayah : Wiraswasta
8. Nama Ibu : Tri Rahayu
9. Pekerjaan Ibu : Ibu Rumah Tangga

B. RIWAYAT PENDIDIKAN

1. SD : SD Islam Setono 02 (2005-2011)
2. SMP : SMP Negeri 7 Pekalongan (2011-2014)
3. SMA : SMK Negeri 2 Pekalongan (2014-2017)

Pekalongan, 16 Oktober 2021



Annisa Dhiyaa Firdaus



**KEMENTERIAN AGAMA REPUBLIK INDONESIA
INSTITUT AGAMA ISLAM NEGERI PEKALONGAN
UNIT PERPUSTAKAAN**

Jl.Kusuma bangsa No.9 Pekalongan.Telp.(0285) 412575 Faks (0285) 423418
Website :perpustakaan iain-pekalongan.ac.id |Email : perpustakaan@iain pekalongan. ac.id

**LEMBAR PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI
KARYA ILMIAH UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS**

Sebagai sivitas akademika IAIN Pekalongan, yang bertanda tangan dibawah ini, saya:

Nama : **ANNISA DHIYAA FIRDAUS**

NIM : **4117260**

Fakultas/Jurusan : **FEBI / Ekonomi Syariah**

Demi pengembangan ilmu pengetahuan, menyetujui untuk memberikan kepada
Perpustakaan IAIN Pekalongan, Hak Bebas Royalti Non-Eksklusif atas karya ilmiah :

Tugas Akhir Skripsi Tesis Desertasi Lain-lain (.....)

**PENGARUH HARGA SAHAM, *BI RATE*, KURS DAN INFLASI TERHADAP *RETURN*
SAHAM SAAT TERJADINYA PANDEMI COVID-19 (STUDI KASUS PERUSAHAAN
YANG TERDAFTAR DI JAKARTA ISLAMIC INDEX)**

beserta perangkat yang di perlukan (bila ada). Dengan Hak Bebas Royalti Non-Eksektif ini Perpustakaan IAIN Pekalongan berhak menyimpan, mengalih-media/format-kan, mengelolanya dalam bentuk pangkalan data (database), mendistribusikannya, dan menampilkan/mempublikasikannya lewat internet atau media lain secara **fulltext** untuk kepentingan akademis tanpa perlu meminta ijin dari saya selama tetap mencantumkan nama saya sebagai penulis/pencipta atau penerbit yang bersangkutan.

Saya bersedia untuk menanggung secara pribadi, tanpa melibatkan pihak Perpustakaan IAIN Pekalongan, segala bentuk tuntutan hukum yang timbul atas pelanggaran Hak Cipta dalam karya ilmiah saya ini

Dengan demikian ini yang saya buat dengan sebenarnya.

Pekalongan, 17 Mei 2021



ANNISA DHIYAA FIRDAUS
NIM. 4117260

NB: Harap diisi, ditempel meterai dan ditandatangani
Kemudian diformat pdf dan dimasukkan dalam cd.