ANALISIS REGRESI BERGANDA

Bentuk persamaan regresi dengan dua variabel indenpenden adalah:

$$Y = a + b_1 X_1 + b_2 X_2$$

Bentuk persaman regresi dengan 3 veriabel independen adalah:

$$Y = a + b X_1 + b_2 X_2 + b_3 X_3$$

Bentuk umum persamaan regresi untuk k variabel indenden dapat dirumuskan sebagai berikut:

$$Y = a + b_1 X_1 + b_2 X_2 + b_3 X_3 + ... + b_k X_k$$

RUMUS

Persamaan untuk mendapatkan koefisien regresi

Prinsip metode ordinary least square(OLS) adalah meminimumkan jumlah kuadrat deviasi di sekitar garis regresi. Nilai koefisien regresi a, b_1 , dan b_2 dapat dipecahkan secara simultan dari tiga persamaan berikut:

CONTOH PERMINTAAN DIPENGARUHI HARGA DAN PENDAPATAN

Nomor Sampel	Permintaan Minyak (liter/bulan)	Harga minyak (Rp ribu/liter)	Pendapatan (Rp juta/bulan)
1	3	8	10
2	4	7	10
3	5	7	8
4	6	7	5
5	6	6	4
6	7	6	3
7	8	6	2
8	9	6	2
9	10	5	1
10	10	5	1

Untuk mendapatkan koefisien regresi, sesuai dengan persamaan (a), (b) dan (c), perlu dihitung lebih dahulu dari nilai-nilai sebagai berikut: ΣY , ΣX_1 , ΣX_2 , ΣX_1Y , ΣX_1^2 , ΣX_1 ΣX_2 , ΣX_2Y , ΣX_2^2

Y	X ₁	X ₂	YX ₁	YX ₂	X ₁ ²	X_{2}^{2}	X_1X_2
3	8	10	24	30	64	100	80
4	7	10	28	40	49	100	70
5	7	8	35	40	49	64	56
6	7	5	42	30	49	25	35
6	6	4	36	24	36	16	24
7	6	3	42	21	36	9	18
8	6	2	48	16	36	4	12
9	6	2	54	18	36	4	12
10	5	1	50	10	25	1	5
10	5	1	50	10	25	1	5
Σ Y=68	$\Sigma X_1 = 63$	$\Sigma X_2 = 46$	$\Sigma X_1 Y = 409$	$\Sigma X_2 Y = 239$	$\sum X_1^2 = 405$	$\sum X_2^2 = 324$	$\sum X_1 \sum X_2 = 317$

$$\sum Y = na + b1\sum X1 + b_2\sum X_2$$
 (a)

$$\sum X_1 Y = a\sum X_1 + b_1\sum X_1^2 + b_2\sum X_1\sum X_2$$
 (b)

$$\sum X_2 Y = a\sum X_2 + b_1\sum X1\sum X_2 + b2\sum X_2^2$$
 (c)

$$68 = 10a + 63b1 + 46b_{2}$$
 (1)

$$409 = 63a + 405b_{1} + 317b_{2}$$
 (2)

$$239 = 46a + 317b_{1} + 324b_{2}$$
 (3)

Untuk mendapatkan nilai koefisien regresi a, b1, dan b2 dapat dilakukan dengan Subtitusi antar persamaan

$$-428,4 = -63a - 396,9 \text{ b1-289,8b2} \qquad \text{persama n 1 dikalikan } -6,3$$

$$409 = 63a + 405b_1 + 317b_2 \dots (2)$$

$$-19,4 = 0 + 8,1b1 + 27,2b_2 \dots (4)$$

$$-312,8 = -46a - 289,8 b_1 - 211,6b_2 Persamaan 1 dikalikan -4,6$$

$$239 = 46a + 317b_1 + 324b_2 (3)$$

$$-73,8 = 0 + 27,2b_1 + 112,4b_2 (5)$$

$$-428,4 = -63a - 396,9 \text{ b1-289,8b2}$$
 persamaan 1 dikalikan -6,3
$$409 = 63a + 405b_1 + 317b_2 \dots (2)$$
$$-19,4 = 0 + 8,1b1 + 27,2b_2 \dots (4)$$

$$-312,8 = -46a - 289,8 b_1 - 211,6b_2 Persamaan 1 dikalikan -4,6$$

$$239 = 46a + 317b_1 + 324b_2 ... (3)$$

$$-73,8 = 0 + 27,2b_1 + 112,4b_2 ... (5)$$

$$-19,4 = 8,1 \text{ b1} + 27,2 \text{ b2}-----(4)$$
 dikalikan dengan 27,2 $-73,8 = 27,2 \text{ b1} + 112,4 \text{ b2}.....(5)$ dikalikan dengan 8,1

Kemudian hasilnya ditambahkan

$$B2 = 70,1/-170,6 = -0,41$$

Analisis Regresi dan Korelasi Linier

CONTOH: PERMINTAAN DIPENGARUHI HARGA DAN PENDAPATAN

Dari persamaan 6, maka nilai b2 adalah = -8,65/21,06 = -0,41. Setelah menemukan nilai b2, maka nilai b1 dapat dicari dengan mempergunakan persamaan 4 atau 5.

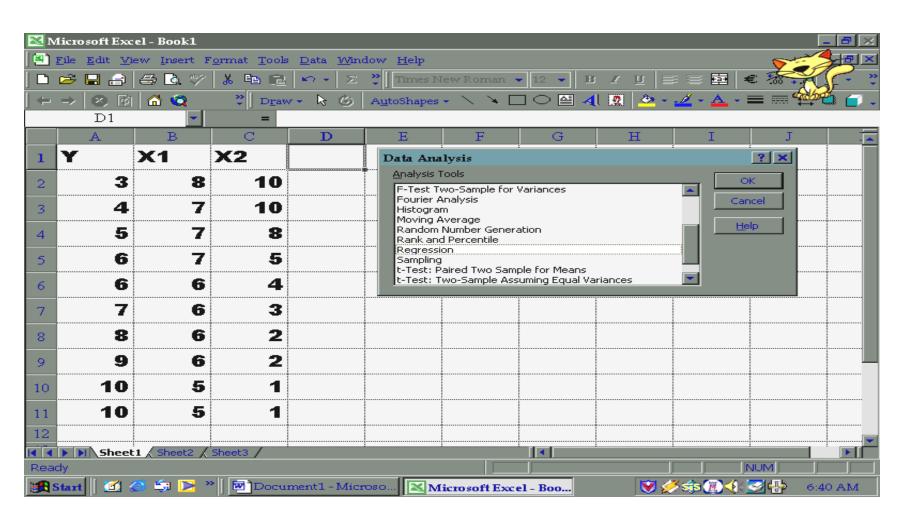
```
68 = 10a + 63(-1,015) + 46(-0,41)....(1)
68 = 10a - 63,96 - 18,90
10a = 63 + 92,86
a = 150,86/10 = 15,086
```

Dengan menemukan nilai koefisien regresi a, b1, dan b2 maka persamaan regresinya dapat dinyatakan sebagai berikut:

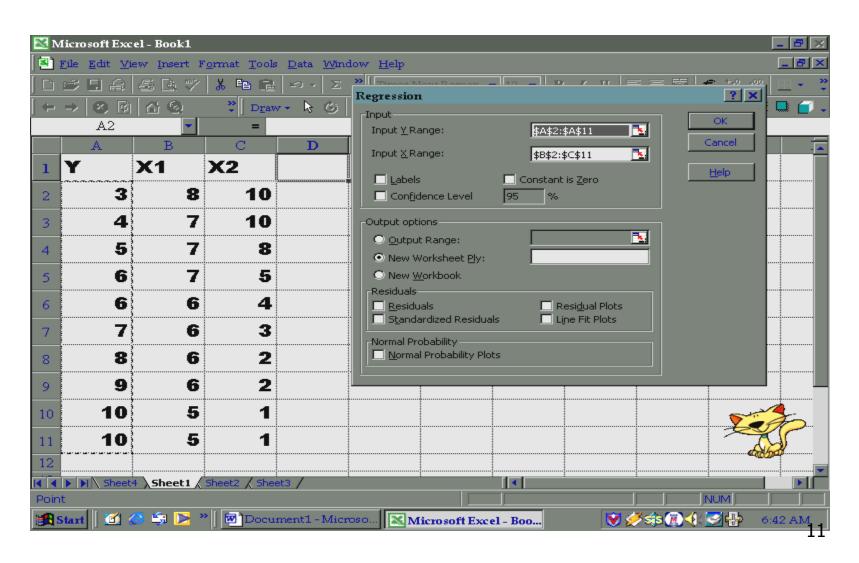
$$Y = 15,086 - 1,015X_1 - 0,41 X_2$$

Analisis Regresi dan Korelasi Linier

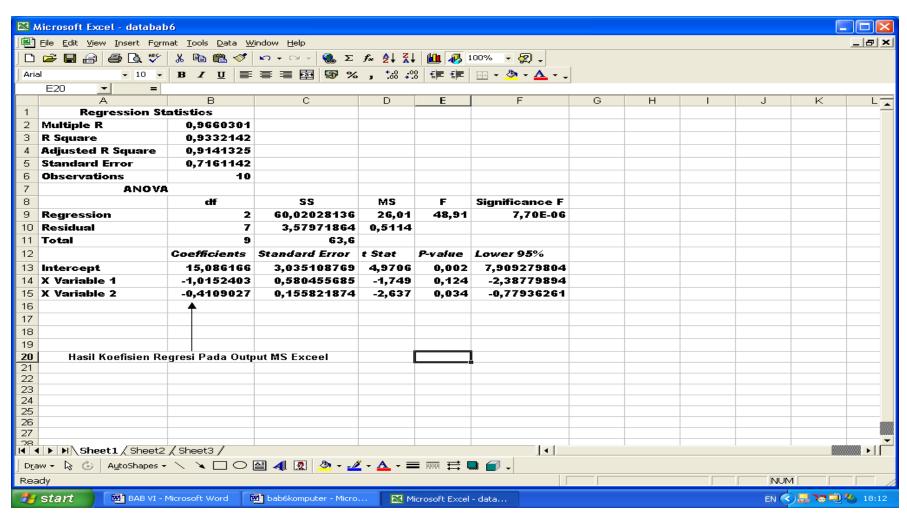
PENGGUNAAN MS EXCEL UNTUK MENCARI KOEFISIEN REGRESI BERGANDA



PENGGUNAAN MS EXCEL UNTUK MENCARI KOEFISIEN REGRESI BERGANDA



PENGGUNAAN MS EXCEL UNTUK MENCARI KOEFISIEN REGRESI BERGANDA



Analisis Dengan SPSS

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.966ª	.933	.914	.715

 a. Predictors: (Constant), Pendapatan (jt rupiah/bln), Harga Mlnyak (Ribu/lt)

ANOVA^a

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	50.020	2	25.010	48.906	<,001 ^b
	Residual	3.580	7	.511		
	Total	53.600	9			

a. Dependent Variable: Permintaan Minyak (Lt/bin)

Coefficientsa

		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients		
Model		В	Std. Error	Beta	t	Sig.
1	(Constant)	15.086	3.035		4.971	.002
	Harga Minyak (Ribu/lt)	-1.015	.580	395	-1.749	.124
	Pendapatan (jt rupiah/bln)	411	.156	595	-2.637	.034

a. Dependent Variable: Permintaan Minyak (Lt/bin)

b. Predictors: (Constant), Pendapatan (jt rupiah/bln), Harga Mlnyak (Ribu/lt)

Analisis Model

- Model Y = a +b1x1 +b2X2 + e
- Perminyaan minyak + a + b1harga +b2 Pendapatan
- Model Regresi $Y = 15,086 1,015X_1 0,41 X_2$
- a= 15.086 artinya apabila nilai x1 dan x2 sama dengan nul maka permintaan minyak sebanyak 15.086 liter
- Koefisien harga sebesar -1,015 artinya apabila naik sebesar 1 lt/bln maka permintaan minyak akan berkurang sebesar 1,057 lt/bln
- Nilai koefisien pendapan sebesar -0,41 menunjukkan bahwa apabilapendapat seseorang meningkat 1 jt/bln maka permintaan akan minyak berkurang/turun sebanyak 0,41 lt/bln.

Untuk menguji apakah nili nilai koefisien regresi itu signifikan atau tidak maka dilakukan dengan uji t.

Uji t (untuk koefisien individu):

Hipotesis koefisien b1:

- H0: Koefisien (b1 = 0 (harga minyak tidak berpengaruh signifikan terhadap permintaan minyak)
- H1: Koefisien (b2 ≠ 0 (harga minyak berpengaruh signifikan terhadap permintaan minyak)

Uji Koefisien b2

- H0: Koefisien (b1 = 0 (pendapatan tidak berpengaruh signifikan terhadap permintaan minyak)
- H1: Koefisien (b2 ≠ 0 (pendapatan berpengaruh signifikan terhadap permintaan minyak)

Kriteria Uji t

- Jika p-value<0,05 maa dapat disimpulkan menolak H0 (koefisien signifikan).
- Jika p-value≥0,05 maka dapat disimpulkan gagal menolak H0 atau kesimulan menerima H1 (koefisien tidak signifikan).

Untuk menguji apakah mpdel ini baik atau tidak digunakan sebagai model, maka dilakukan dengan uji F. uji F ini sering disebut sebagai uji Goodness of Fit. Uji kesesuaian model.

Tujuan: Untuk menguji apakah model regresi secara keseluruhan signifikan (variabel-variabel independen memiliki pengaruh bersama-sama terhadap variabel dependen).

Hipotesis:

H0: Semua koefisien regresi = 0 (model tidak signifikan).

H1: Minimal satu koefisien regresi ≠ 0 (model signifikan).

Kriteria Uji

- •Jika p-value<0,05: tolak H0 (model signifikan).
- •Jika p-value≥0,05, maka kesimpulan gagal menolak H0 (model tidak siginifikan).

Hsil Uji/Kesimpulan: Menerima H1, artinya model yang dibangun dapat dipakai untuk

Kesimpulan

- Nilai P valu a = 0,002 ---→signifikan
- Nilai p valu x1 = 0.124 --- \rightarrow tidak signifikan
- Nilai p value $x2 = 0.034 --- \Rightarrow$ signifikan

STUDI KASUS 2

CONTOH KASUS: KEUNTUNGAN DIPENGARUHI ASET DAN HARGA SAHAM PERBANKAN

Bank	Keuntungan Bersih 2002 (miliar)	Total Aset (triliun)	Harga Saham (Rupiah/Lb)
Mandiri	3586	250	800
BNI	2508	125	140
BCA	2541	117	3050
BRI	1524	86	1250
Danamon	948	46	1575
BII	132	36	100
Niaga	150	27	260

$$\mathbf{Y} = \mathbf{a} + \mathbf{b}_1 \mathbf{X}_1 + \mathbf{b}_2 \mathbf{X}_2$$

Di mana

Y : Keuntungan perusahaan (miliar/tahun)

X₁ : Total Aset (triliun/tahun)

X, : Harga saham (Rupiah/lembar)

CONTOH KASUS: KEUNTUNGAN DIPENGARUHI ASET DAN HARGA SAHAM PERBANKAN

Regressi	ion Statistics			
Multiple R	0,964			
R Square	0,930			
Adjusted R Square	0,895			
Standard Error	424,550			
Observations	7			
A	NOVA			
	df	SS	MS	F
Regression	2	9616470	4808235	26,676
Residual	4	720971	180242	
Total	6	10337442		
	Coefficients	Standard Error	t Stat	P-value
Intercept	-168,833	306,835	-0,55	0,611
X Variable 1	15,496	2,257	6,865	0,002
X Variable 2	0,268	0,165	1,627	0,179
Durbin-watson	2,151			
Coefficient Correlations				
	X Variable 1	X Variable 2		
X Variable 1	1	-0,124		
X Variable 2	-0,124	1		

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	.964ª	.930	.895	424.550

 a. Predictors: (Constant), Harga saham (rupiah/lbr), Total Assets (triliun)

ANOVA^a

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	9616470.059	2	4808235.030	26.676	.005 ^b
	Residual	720971.941	4	180242.985		
	Total	10337442.00	6			

a. Dependent Variable: Keuntungan Bersih (miliar)

b. Predictors: (Constant), Harga saham (rupiah/lbr), Total Assets (triliun)

Coefficientsa

		Unstandardize	d Coefficients	Standardized Coefficients			
Model		В	Std. Error	Beta	t	Sig.	
1	(Constant)	-168.833	306.835		550	.611	
	Total Assets (triliun)	15.496	2.257	.914	6.865	.002	
	Harga saham (rupiah/lbr)	.268	.165	.216	1.627	.179	

a. Dependent Variable: Keuntungan Bersih (miliar)

CONTOH KASUS: KEUNTUNGAN DIPENGARUHI ASET DAN HARGA SAHAM PERBANKAN

$$Y = -168,833 + 15,496 X_1 + 0,268 X_2 \\ (t=-0,55) \quad (t=6,865) \quad (t=1,627) \\ R \ Square = 0,930 \\ Dw = 2,151 \\ rX_1X_2Y = -0,124$$

Persamaan $Y = -168,833 + 15,496 X_1 + 0,268 X_2$ menyatakan bahwa apabila aset (X_1) meningkat 1 triliun, maka keuntungan (Y) meningkat 15,496 miliar rupiah, dengan demikian return on asset diperbankan dapat diperkiran sebesar 1,55% dan hal ini sudah sesuai dengan data ROA seluruh perbankan yaitu 1,57% pada tahun 2003. Apabila harga saham (X_2) naik 1 rupiah, maka keuntungan perusahaan meningkat 0,268 miliar.

Nilai R2= 0,930 ini menunjukkan kemampuan variabel asset dan harga saham menjelaskan perilaku keuntungan perusahaan sebesar 93% dan sisanya atau residu sebesar 7% dijelaskan oleh variabel lain yang tidak dimasukkan dan diteliti dalam persamaan tersebut. ini menunjukkan spesifikasi yang baik, karena kemampuan menjelaskannya relatif besar.

Uji Koefisein B1

```
Ho: b1 sama dengan nol
```

H1: b1 tidak sama dengan nol

alap 5% = 0.05

P V,,,?

Kriteria Uji

- apabila %alpa < dari Pv maka menrima Ho
- apabila %alpa > dari PV hitung maka menrima H1

pv =0.0,002, kaena PV lebih kecil dibanding dengan probability alpha maka dalam hasil uji ini menerima H1 dan menolak Ho. Artinya terdapat bukti yang kuat adanya penagaruh positif hubungan X1 dengan Y

Uji Koefisein B2

Ho: b2 sama dengan nol

H1: b2 tidak sama dengan nol

alap 5% = 0.05

P V,,,?

Kriteria Uji

- apabila %alpa < dari Pv maka menrima Ho
- apabila %alpa > dari PV hitung maka menrima H1

pv = 0.179

Karena Pv > dari Probabilitas, maka menerima Ho dan Menoolah H1, artinya tidak terapat pengaruh yang signifikan hubungan antara X2(HARGA SAHAM) dengan Y

TERIMA KASIH

No	Tahun	Y (Harga Saham)	X ₁ (PER%)	X2 (ROI%)
1	1991	7500	3.28	3.14
2	1992	8950	5.05	5
3	1993	8250	4	4.75
4	1994	9000	5.97	6.23
5	1995	8750	4.24	6.03
6	1996	10000	8	8.75
7	1997	8200	7.45	7.72
8	1998	8300	7.47	8
9	1999	10900	12.68	10.4
10	2000	12800	14.45	12.42
11	2001	9450	10.5	8.62
12	2002	13000	17.24	12.07
13	2003	8000	15.56	5.83
14	2004	6500	10.85	5.2
15	2005	9000	16.56	8.53
16	2006	7600	13.24	7.37
17	2007	10200	16.98	9.38
18	2008	10600	16.57	9.2
19	2009	9270	14.83	8.82
20	2010	11430	16.93	10.25

Instruksi

- Buatlah model regresi
 Beganda dan jelaskan dari odel tersebut
- Berapa nilai harga saham apabila Perusahaan mempunyai PER sebesar 8,3% dan ROI sebesar 11,7%.
- 3. Hitung nilai Korelasi dan artinya
- 4. Hitung Nilai Koefisien Determinan dan artinya
- 5. Lakukan Uji F
- Lakukan Uji Koefisien X1,
 X2 secara parsial dengan uji
 t

Soal Latihan

 Diberikan data tentang IQ dan tingkat kehadiran sepuluh mahaiswa di kelas yang diperkirakan mempengaruhi nilai UAS

Cierro	IQ	Tingkat kehadiran (%)	Nilai UAS
Siswa	(X ₂)	(X ₁)	(Y)
1	110	60	65
2	120	70	70
3	115	75	75
4	130	80	75
5	110	80	80
6	120	90	80
7	120	95	85
8	125	95	95
9	110	100	90
10	120	100	98