

DAFTAR TABEL

| No. | Keterangan | Halaman |
|-----|---|---------|
| 1.1 | Tabel Persentase Pergerakan Return Saham | 2 |
| 2.1 | Penelitian Terdahulu | 41 |
| 3.1 | Pengukuran Operasional Variabel Penelitian..... | 52 |
| 3.2 | Jumlah Sampel Penelitian | 54 |
| 3.3 | Daftar Sampel Sektor Barang Konsumsi | 55 |
| 3.4 | Keputusan Uji Autokorelasi | 60 |
| 4.1 | Daftar Sampel Sektor Barang Konsumsi | 64 |
| 4.2 | Hasil Uji Statistik Deskriptif | 65 |
| 4.3 | Hasil Uji Kolmogorov-Smirnov (K-S)..... | 69 |
| 4.4 | Hasil Uji Multikolonieritas | 70 |
| 4.5 | Hasil Uji Autokorelasi | 72 |
| 4.6 | Hasil Uji Uji Koefisien Determinasi..... | 73 |
| 4.7 | Hasil Uji Signifikansi Simultan (Uji F) | 75 |
| 4.8 | Hasil Uji Signifikansi Parameter Individual | 70 |
| 4.9 | Hasil Uji Analisis Linear (Uji t) Berganda | 72 |