

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	24
Tabel 3.1 Prosedur Pemilihan Sampel	34
Tabel 3.2 Operasional Variabel	34
Tabel 4.1 Teknik Pengambilan Sampel	50
Tabel 4.2 Sampel Penelitian	52
Tabel 4.3 Tingkat Pengembalian Saham Individu (R_i) Periode 2021 – 2024	59
Tabel 4.4 Tingkat Pengembalian Pasar (R_M) Periode 2021 –2024	62
Tabel 4.5 Tingkat Pengembalian Bebas Risiko (R_f) Periode 2021 – 2024	66
Tabel 4.6 Beta Saham (β_i) ADRO Periode 2021 – 2024.....	70
Tabel 4.7 Beta Saham (β_i) Periode 2021 – 2024	73
Tabel 4.8 Perhitungan Tingkat Pengembalian yang Diharapkan [$E(R_i)$]	75
Tabel 4.9 Beta (β_i) dan Return Ekspektasi $E(R_i)$ Periode 2021 – 2024	77
Tabel 4.10 Penggolongan Saham Efisien dan Tidak Efisien serta Keputusan Investasi	80
Tabel 4.11 Kelompok Saham Efisien berdasarkan CAPM.....	82
Tabel 4.12 Peringkat Saham Efisien.....	82
Tabel 4.13 Pengelompokan SMB dan HML Periode Januari 2024.....	84
Tabel 4.14 Perhitungan SMB dan HML Periode 2024.....	84
Tabel 4.15 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	85
Tabel 4.16 Hasil Uji Multikolinearitas.....	88
Tabel 4.17 Hasil Uji Heteroskedastisitas	89
Tabel 4.18 Hasil Uji Autokorelasi	90
Tabel 4.19 Hasil Uji Chow	90
Tabel 4.20 Hasil Uji Hausman.....	91
Tabel 4.21 Hasil Uji Lagrange Multiplier.....	92
Tabel 4.22 Persamaan Regresi Linier	93
Tabel 4.23 Uji Signifikansi (F-Statistik).....	94
Tabel 4.24 Uji t.....	95
Tabel 4.25 Koefisien Determinasi (R^2)	95
Tabel 4.26 Uji ANOVA.....	96