

DAFTAR TABEL

Nomor	halaman	
1.1.	Perbandingan kinerja pertumbuhan <i>return</i> IHSG harian, <i>return</i> LQ-45 harian, <i>return</i> JII harian, pada periode 30 Oktober 2007 – 8 Januari 2008.....	10
2.1.	Ringkasan Pengujian Pasar Efisien atas Informasi Non Akuntansi dan Informasi Akuntansi.....	54
2.2.	Beberapa Pengujian Pasar Efisien.....	55
2.3.	Anomali pada Pasar Sekuritas (Saham).....	59
2.4.	Sejumlah Penelitian Terkait Mengenai Hipotesis Pasar Efisien Bentuk Lemah.....	63
3.1.	Daftar Jumlah Perusahaan Masuk / Keluar di JII.....	68
3.2.	Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	69
3.3.	Sampel Lima Emiten dari Populasi 176 Emiten selama 11 Periode JII.....	72
3.4.	Ranking Konsistensi dari 11 Periode JII (Januari 2004 – Mei 2009).....	73
4.1.	Statistik Deskriptif Lima Sampel.....	86
4.2.	Pembahasan Statistik Deskriptif Lima Sampel.....	86
4.3.	Pembahasan Kolmogorov-Smirnov Lima Sampel.....	87
4.4.	Kolmogorov-Smirnov Lima Sampel.....	87
4.5.	<i>Run Test</i> Lima Sampel.....	88
4.6.	Pembahasan <i>Run Test</i> Lima Sampel.....	88
4.7.	Pembahasan Otokorelasi Lima Sampel.....	89
4.8.	ADF Tes Tanpa Diferensial.....	89
4.9.	ADF Tes Dengan Diferensial Order 1.....	90
4.10.	<i>Model Selection Criteria</i> BUMI.....	90
4.11.	<i>Model Selection Criteria</i> INTIP.....	91
4.12.	<i>Model Selection Criteria</i> KLBF.....	93

4.13.	<i>Model Selection Criteria</i> PTBA.....	93
4.14.	<i>Model Selection Criteria</i> UNVR.....	94
4.15.	Hasil Pengujian Hipotesis.....	95