**DAFTAR LAMPIRAN**

Lampiran 1 : Daftar Perusahaan Sample Penelitian 50

Lampiran 2 : Contoh Data Sample Perusahaan 51

Lampiran 3 : Hasil Uji 59

 3.1 Uji Beda *Return Open-Close* 59

 3.2 Uji Beda *Return Close-Close* 61

 3.1 Uji Beda *Return Volume (Shares)* 63

 3.1 Uji Logit *Return Open-Close* 65

 3.1 Uji Logit *Return Close-Close* 69