**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