

LAMPIRAN 1
Return Saham Selama Periode Pengamatan

No	Kode	Sektor	h-5	h-4	h-3	h-2	h-1	Rata-rata Sebelum	h+1	h+2	h+3	h+4	h+5	Rata-rata Sesudah
1	TMAS	infrastruktur	0,5182	0,5091	0,4909	0,5091	0,4545	0,4964	0,4364	0,4364	0,4364	0,4364	0,4364	0,4364
2	META	infrastruktur	-0,0350	-0,0300	-0,0300	-0,0350	-0,0500	-0,0360	-0,0300	-0,0250	-0,0250	-0,0300	-0,0500	-0,0320
3	RIGS	infrastruktur	0,0720	0,0800	0,0800	0,0880	0,0960	0,0832	0,1360	0,1280	0,1360	0,1360	0,1600	0,1392
4	BLTA	infrastruktur	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000	-0,9000
5	CMPP	infrastruktur	0,0204	0,0204	-0,0041	-0,0204	-0,0204	-0,0008	0,2653	0,5755	0,9673	1,4490	1,6531	0,9820
6	LEAD	infrastruktur	1,3214	1,3214	1,1786	1,2500	1,2500	1,2643	1,3214	1,3214	1,2857	1,3214	1,3214	1,3143
7	CENT	infrastruktur	0,1600	0,2000	0,1680	0,1520	0,2000	0,1760	0,1360	0,2880	0,2560	0,2160	0,0880	0,1968
8	JSMR	infrastruktur	0,1270	0,1162	0,1568	0,1703	0,1973	0,1535	0,2108	0,2243	0,2135	0,1784	0,1838	0,2022
9	EXCL	infrastruktur	0,5000	0,4480	0,3880	0,4080	0,4400	0,4368	0,3880	0,3920	0,3640	0,3360	0,2640	0,3488
10	SUPR	infrastruktur	-0,0706	-0,0647	-0,0647	-0,0588	-0,0588	-0,0635	-0,0588	-0,0647	-0,0588	-0,0588	-0,0529	-0,0588
11	BBRM	infrastruktur	-0,1045	-0,1045	-0,1364	-0,1182	-0,1364	-0,1200	-0,0864	0,1818	-0,1000	-0,1000	-0,1318	-0,0473
12	IBST	infrastruktur	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067	0,1067
13	CMNP	infrastruktur	-0,1500	-0,1563	-0,1469	-0,1469	-0,1563	-0,1513	-0,1438	-0,1438	-0,1469	-0,1438	-0,1375	-0,1431
14	RAJA	infrastruktur	1,3864	1,4545	1,3636	1,2636	1,2727	1,3482	1,3864	1,4091	1,4545	1,3636	1,4545	1,4136
15	SHIP	infrastruktur	2,7321	2,9286	2,9821	3,0357	3,0714	2,9500	3,3571	3,4464	3,4464	3,4464	3,4464	3,4286
16	WINS	infrastruktur	-0,0914	-0,0571	-0,0457	-0,0629	-0,0629	-0,0640	-0,0800	-0,0857	-0,0914	-0,0686	-0,0457	-0,0743
17	IATA	infrastruktur	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455
18	BTEL	infrastruktur	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455	-0,5455
19	GIAA	infrastruktur	-0,3564	-0,3455	-0,3236	-0,3273	-0,3200	-0,3345	-0,3091	-0,3164	-0,3127	-0,3200	-0,3127	-0,3142

20	SDMU	infrastruktur	0,0311	0,0133	0,0667	0,0400	0,0044	0,0311	0,1911	0,2533	0,3422	0,3067	0,3156	0,2818
21	SAFE	infrastruktur	-0,6917	-0,6583	-0,6250	-0,5833	-0,6806	-0,6478	-0,7528	-0,7833	-0,6583	-0,6250	-0,6250	-0,6889
22	HITS	infrastruktur	-0,0519	-0,0667	-0,0889	-0,0963	-0,0889	-0,0785	0,0074	0,0074	-0,0667	-0,0370	0,0519	-0,0074
23	MDKA	Tambang	0,8640	0,8640	0,8640	0,8240	0,8640	0,8560	0,8720	0,8840	0,8680	0,8680	0,8800	0,8744
24	ESSA	Tambang	-0,5049	-0,5016	-0,5148	-0,5148	-0,5049	-0,5082	-0,4918	-0,4984	-0,4984	-0,4951	-0,5016	-0,4970
25	BUMI	Tambang	-0,6629	-0,6629	-0,6600	-0,6629	-0,6514	-0,6600	-0,6600	-0,6629	-0,6543	-0,6543	-0,6600	-0,6583
26	ANTM	Tambang	-0,2364	-0,2273	-0,2227	-0,2500	-0,2500	-0,2373	-0,2318	-0,2318	-0,2591	-0,2273	-0,2318	-0,2364
27	ARTI	Tambang	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333	-0,8333
28	MTFN	Tambang	0,2444	0,2222	0,2222	0,2222	0,2667	0,2356	0,2444	0,2444	0,2444	0,2444	0,2444	0,2444
29	ENRG	Tambang	2,6875	2,7500	2,7500	2,6875	2,8125	2,7375	2,8125	2,6875	2,6875	2,7500	2,7500	2,7375
30	BIPI	Tambang	-0,5571	-0,6286	-0,6357	-0,6429	-0,6429	-0,6214	-0,5786	-0,5714	-0,5286	-0,6429	-0,6429	-0,5929
31	BRMS	Tambang	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126	-0,2126
32	MITI	Tambang	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980	-0,8980
33	PTBA	Tambang	3,9391	4,0609	4,1130	4,0957	4,0957	4,0609	4,3043	4,2174	4,2348	4,3217	4,1478	4,2452
34	BORN	Tambang	0,6154	0,6325	0,6068	0,6026	0,6453	0,6205	0,6239	0,6197	0,6154	0,5769	0,5128	0,5897
35	ITMG	Tambang	0,2321	0,2286	0,2500	0,2429	0,2357	0,2379	0,2500	0,2321	0,2732	0,2536	0,2607	0,2539
36	DEWA	Tambang	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485	-0,8485
37	ARII	Tambang	-0,3292	-0,3333	-0,3333	-0,3333	-0,3292	-0,3317	-0,3333	-0,3333	-0,3333	-0,3333	-0,3333	-0,3333
38	ADHI	Propeti	0,4567	0,5533	0,5467	0,5633	0,5633	0,5367	0,5233	0,4900	0,3767	0,3833	0,4133	0,4373
39	ACSET	Propeti	0,2280	0,2560	0,2680	0,2800	0,2880	0,2640	0,2720	0,2640	0,2880	0,2800	0,3000	0,2808
40	WIKA	Propeti	1,1636	1,1818	1,2364	1,2273	1,1909	1,2000	1,1455	1,1182	1,2182	1,1455	1,2364	1,1727
41	PTPP	Propeti	1,4733	1,4600	1,5400	1,5400	1,5667	1,5160	1,3867	1,3600	1,4000	1,4933	1,4267	1,4133
42	PPRO	Propeti	0,2865	0,3189	0,2541	0,3297	0,3514	0,3081	0,4486	0,4703	0,4486	0,4703	0,4919	0,4659
43	RBMS	Propeti	-0,6650	-0,6600	-0,6675	-0,6675	-0,6575	-0,6635	-0,6500	-0,6425	-0,6375	-0,6225	-0,6250	-0,6355

LAMPIRAN 2
Abnormal Return Saham Selama Periode Pengamatan

No	Kode	Sektor	h-5	h-4	h-3	h-2	h-1	Rata-rata Sebelum	h+1	h+2	h+3	h+4	h+5	Rata-rata Sesudah
1	TMAS	infrastructure	0,4878	0,4948	0,4873	0,5172	0,4694	0,4913	0,4407	0,4399	0,4469	0,4395	0,4417	0,4417
2	META	infrastructure	-0,0284	-0,0241	-0,0107	-0,0441	-0,0428	-0,0300	-0,0206	-0,0246	-0,0333	-0,0345	-0,0463	-0,0319
3	RIGS	infrastructure	0,0707	0,0808	0,0844	0,0970	0,1056	0,0877	0,1403	0,1264	0,1389	0,1154	0,1615	0,1365
4	BLTA	infrastructure	-0,8951	-0,8953	-0,9088	-0,9011	-0,8825	-0,8965	-0,8853	-0,9030	-0,9137	-0,9100	-0,9056	-0,9035
5	CMPP	infrastructure	0,0246	0,0229	-0,0002	-0,0254	-0,0222	-0,0001	0,2620	0,5835	0,9702	1,4612	1,6500	0,9854
6	LEAD	infrastructure	1,3335	1,3221	1,1858	1,2560	1,2448	1,2684	1,3292	1,3060	1,2783	1,3219	1,3201	1,3111
7	CENT	infrastructure	0,1296	0,1857	0,1644	0,1601	0,2148	0,1709	0,1403	0,2915	0,2665	0,2191	0,0933	0,2022
8	JSMR	infrastructure	0,1337	0,1221	0,1761	0,1612	0,2045	0,1595	0,2202	0,2247	0,2052	0,1739	0,1875	0,2023
9	EXCL	infrastructure	0,4987	0,4488	0,3924	0,4170	0,4496	0,4413	0,3923	0,3904	0,3669	0,3154	0,2655	0,3461
10	SUPR	infrastructure	-0,0657	-0,0600	-0,0735	-0,0600	-0,0413	-0,0601	-0,0441	-0,0677	-0,0725	-0,0688	-0,0586	-0,0623
11	BBRM	infrastructure	-0,1003	-0,1021	-0,1325	-0,1231	-0,1381	-0,1192	-0,0897	0,1899	-0,0972	-0,0878	-0,1349	-0,0439
12	IBST	infrastructure	0,1187	0,1074	0,1139	0,1127	0,1015	0,1108	0,1145	0,0913	0,0992	0,1072	0,1053	0,1035
13	CMNP	infrastructure	-0,1380	-0,1556	-0,1397	-0,1408	-0,1615	-0,1471	-0,1359	-0,1592	-0,1543	-0,1432	-0,1389	-0,1463
14	RAJA	infrastructure	1,3560	1,4402	1,3600	1,2717	1,2876	1,3431	1,3907	1,4126	1,4651	1,3667	1,4599	1,4190
15	SHIP	infrastructure	2,7388	2,9345	3,0015	3,0267	3,0786	2,9560	3,3666	3,4468	3,4382	3,4419	3,4501	3,4287
16	WINS	infrastructure	-0,0928	-0,0564	-0,0413	-0,0539	-0,0532	-0,0595	-0,0757	-0,0873	-0,0885	-0,0891	-0,0442	-0,0770
17	IATA	infrastructure	-0,5405	-0,5407	-0,5542	-0,5466	-0,5279	-0,5420	-0,5308	-0,5484	-0,5591	-0,5554	-0,5511	-0,5490
18	BTEL	infrastructure	-0,5412	-0,5430	-0,5416	-0,5504	-0,5472	-0,5447	-0,5488	-0,5374	-0,5426	-0,5333	-0,5485	-0,5421
19	GIAA	infrastructure	-0,3443	-0,3448	-0,3164	-0,3212	-0,3252	-0,3304	-0,3013	-0,3318	-0,3201	-0,3195	-0,3141	-0,3174

20	SDMU	infrastructure	0,0377	0,0192	0,0860	0,0309	0,0116	0,0371	0,2005	0,2537	0,3339	0,3022	0,3192	0,2819
21	SAFE	infrastructure	-0,6930	-0,6576	-0,6206	-0,5744	-0,6709	-0,6433	-0,7485	-0,7849	-0,6554	-0,6456	-0,6235	-0,6916
22	HITS	infrastructure	-0,0469	-0,0619	-0,0977	-0,0974	-0,0713	-0,0751	0,0221	0,0044	-0,0804	-0,0470	0,0462	-0,0109
23	MDKA	Tambang	0,8682	0,8665	0,8679	0,8190	0,8622	0,8568	0,8687	0,8920	0,8708	0,8802	0,8770	0,8777
24	ESSA	Tambang	-0,4929	-0,5010	-0,5076	-0,5087	-0,5101	-0,5040	-0,4840	-0,5138	-0,5058	-0,4946	-0,5030	-0,5002
25	BUMI	Tambang	-0,6933	-0,6772	-0,6636	-0,6548	-0,6366	-0,6651	-0,6557	-0,6594	-0,6438	-0,6512	-0,6547	-0,6529
26	ANTM	Tambang	-0,2297	-0,2214	-0,2034	-0,2591	-0,2428	-0,2313	-0,2224	-0,2314	-0,2674	-0,2318	-0,2281	-0,2362
27	ARTI	Tambang	-0,8347	-0,8326	-0,8290	-0,8244	-0,8237	-0,8289	-0,8290	-0,8349	-0,8304	-0,8539	-0,8318	-0,8360
28	MTFN	Tambang	0,2493	0,2270	0,2135	0,2211	0,2842	0,2390	0,2591	0,2415	0,2308	0,2345	0,2388	0,2409
29	ENRG	Tambang	2,6917	2,7525	2,7539	2,6825	2,8107	2,7383	2,8092	2,6955	2,6903	2,7622	2,7470	2,7408
30	BIPI	Tambang	-0,5876	-0,6429	-0,6394	-0,6348	-0,6280	-0,6265	-0,5742	-0,5679	-0,5181	-0,6398	-0,6375	-0,5875
31	BRMS	Tambang	-0,2060	-0,2067	-0,1933	-0,2217	-0,2054	-0,2066	-0,2032	-0,2122	-0,2209	-0,2171	-0,2089	-0,2125
32	MITI	Tambang	-0,8993	-0,8972	-0,8936	-0,8890	-0,8884	-0,8935	-0,8937	-0,8996	-0,8951	-0,9186	-0,8965	-0,9007
33	PTBA	Tambang	3,9440	4,0656	4,1043	4,0945	4,1132	4,0643	4,3190	4,2144	4,2211	4,3118	4,1422	4,2417
34	BORN	Tambang	0,6196	0,6349	0,6107	0,5976	0,6435	0,6213	0,6206	0,6277	0,6182	0,5891	0,5098	0,5931
35	ITMG	Tambang	0,2442	0,2293	0,2572	0,2489	0,2305	0,2420	0,2578	0,2167	0,2658	0,2541	0,2593	0,2508
36	DEWA	Tambang	-0,8365	-0,8478	-0,8413	-0,8424	-0,8537	-0,8443	-0,8407	-0,8639	-0,8559	-0,8480	-0,8499	-0,8517
37	ARII	Tambang	-0,3596	-0,3477	-0,3370	-0,3252	-0,3143	-0,3368	-0,3290	-0,3298	-0,3228	-0,3302	-0,3280	-0,3280
38	ADHI	Properti	0,4263	0,5390	0,5430	0,5714	0,5782	0,5316	0,5277	0,4935	0,3872	0,3864	0,4187	0,4427
39	ACST	Properti	0,2339	0,2753	0,2589	0,2872	0,3077	0,2726	0,2724	0,2557	0,2835	0,2837	0,3031	0,2797
40	WIKA	Properti	1,1623	1,1826	1,2407	1,2362	1,2005	1,2045	1,1497	1,1166	1,2211	1,1249	1,2379	1,1701
41	PTPP	Properti	1,4782	1,4647	1,5312	1,5389	1,5842	1,5195	1,4014	1,3570	1,3863	1,4834	1,4210	1,4098
42	PPRO	Properti	0,2907	0,3214	0,2579	0,3248	0,3496	0,3089	0,4453	0,4783	0,4515	0,4825	0,4889	0,4693
43	RBMS	Properti	-0,6530	-0,6593	-0,6603	-0,6615	-0,6627	-0,6594	-0,6422	-0,6579	-0,6449	-0,6220	-0,6264	-0,6014

LAMPIRAN 3
Volume Perdagangan (TVA) Saham Selama Periode Pengamatan

No	Kode	Sektor	h-5	h-4	h-3	h-2	h-1	Rata-rata Sebelum	h+1	h+2	h+3	h+4	h+5	Rata-rata Setelah
1	TMAS	infrastructure	0,0001	0,0001	0,0001	0,0001	0,0002	0,0001	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
2	META	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
3	RIGS	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0002	0,0002	0,0000	0,0001	0,0001	0,0002	0,0001	0,0000	0,0002	0,0001
4	BLTA	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
5	CMPP	infrastructure	0,0001	0,0001	0,0001	0,0001	0,0000	0,0001	0,0006	0,0001	0,0002	0,0003	0,0036	0,0009
6	LEAD	infrastructure	0,0131	0,0321	0,0152	0,0161	0,0091	0,0171	0,0508	0,0205	0,0185	0,0173	0,0525	0,0319
7	CENT	infrastructure	0,0002	0,0004	0,0011	0,0003	0,0008	0,0005	0,0016	0,0028	0,0099	0,0139	0,0072	0,0071
8	JSMR	infrastructure	0,0008	0,0013	0,0014	0,0008	0,0007	0,0010	0,0011	0,0014	0,0021	0,0037	0,0011	0,0019
9	EXCL	infrastructure	0,0010	0,0013	0,0017	0,0016	0,0013	0,0014	0,0037	0,0018	0,0017	0,0037	0,0054	0,0033
10	SUPR	infrastructure	0,0012	0,0001	0,0000	0,0004	0,0002	0,0004	0,0002	0,0001	0,0007	0,0002	0,0002	0,0003
11	BBRM	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0001	0,0000	0,0001	0,0000	0,0001	0,0005	0,0007	0,0003	0,0000	0,0003
12	IBST	infrastructure	0,0004	0,0004	0,0005	0,0009	0,0025	0,0010	0,0051	0,0053	0,0079	0,0198	0,0519	0,0180
13	CMNP	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
14	RAJA	infrastructure	0,0063	0,0166	0,0017	0,0008	0,0016	0,0054	0,0002	0,0003	0,0012	0,0001	0,0001	0,0004
15	SHIP	infrastructure	0,0002	0,0001	0,0001	0,0001	0,0001	0,0001	0,0000	0,0002	0,0002	0,0002	0,0002	0,0002
16	WINS	infrastructure	0,0003	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0001	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0001	0,0000
17	IATA	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0002	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
18	BTEL	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
19	GIAA	infrastructure	0,0002	0,0005	0,0001	0,0003	0,0003	0,0003	0,0002	0,0006	0,0003	0,0005	0,0009	0,0005

20	SDMU	infrastructure	0,0007	0,0001	0,0023	0,0007	0,0002	0,0008	0,0004	0,0002	0,0003	0,0003	0,0002	0,0003
21	SAFE	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
22	HITS	infrastructure	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
23	MDKA	Tambang	0,0004	0,0006	0,0009	0,0004	0,0004	0,0005	0,0008	0,0003	0,0002	0,0003	0,0007	0,0005
24	ESSA	Tambang	0,0007	0,0008	0,0008	0,0004	0,0006	0,0007	0,0003	0,0010	0,0003	0,0005	0,0013	0,0007
25	BUMI	Tambang	0,0027	0,0014	0,0020	0,0013	0,0021	0,0019	0,0018	0,0035	0,0018	0,0032	0,0049	0,0031
26	ANTM	Tambang	0,0014	0,0021	0,0020	0,0011	0,0034	0,0020	0,0047	0,0055	0,0027	0,0044	0,0101	0,0055
27	ARTI	Tambang	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
28	MTFN	Tambang	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
29	ENRG	Tambang	0,0015	0,0027	0,0015	0,0021	0,0052	0,0026	0,0068	0,0276	0,0153	0,0035	0,0028	0,0112
30	BIPI	Tambang	0,0022	0,0012	0,0024	0,0008	0,0005	0,0014	0,0006	0,0004	0,0020	0,0024	0,0015	0,0014
31	BRMS	Tambang	0,0000	0,0000	0,0000	0,0001	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0001	0,0000
32	MITI	Tambang	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
33	PTBA	Tambang	0,0031	0,0019	0,0017	0,0025	0,0038	0,0026	0,0022	0,0032	0,0041	0,0023	0,0028	0,0029
34	BORN	Tambang	0,0001	0,0000	0,0004	0,0000	0,0004	0,0002	0,0001	0,0000	0,0000	0,0004	0,0001	0,0001
35	ITMG	Tambang	0,0012	0,0012	0,0007	0,0012	0,0005	0,0010	0,0001	0,0013	0,0013	0,0009	0,0006	0,0008
36	DEWA	Tambang	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
37	ARII	Tambang	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
38	ADHI	Properti	0,0130	0,0073	0,0103	0,0155	0,0196	0,0131	0,0361	0,0322	0,0125	0,0097	0,0080	0,0197
39	ACST	Properti	0,0018	0,0035	0,0005	0,0002	0,0008	0,0014	0,0016	0,0004	0,0054	0,0023	0,0036	0,0027
40	WIKA	Properti	0,0013	0,0023	0,0012	0,0016	0,0015	0,0016	0,0015	0,0017	0,0026	0,0017	0,0039	0,0023
41	PTPP	Properti	0,0033	0,0018	0,0037	0,0038	0,0027	0,0031	0,0032	0,0014	0,0016	0,0028	0,0017	0,0021
42	PPRO	Properti	0,0006	0,0014	0,0010	0,0005	0,0011	0,0009	0,0005	0,0003	0,0010	0,0005	0,0004	0,0005
43	RBMS	Properti	0,0013	0,0040	0,0058	0,0035	0,0055	0,0040	0,0060	0,0099	0,0046	0,0104	0,0095	0,0081

LAMPIRAN 4
Uji Analisis Statistik Deskriptif

Analisis Deskriptif Statistik Return Saham

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
R_SBLM t-5	43	-,9000	1,3482	,053895	,6114967
R_SSDH t+5	43	-,9000	1,4136	,080528	,6237511
Valid N (listwise)	43				

Analisis Deskriptif Statistik Abnormal Return Saham

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
AR_SBLM t-5	43	-,8965	1,5195	,056291	,6286396
AR_SSDH t+5	43	-,9035	1,4190	,081209	,6298709
Valid N (listwise)	43				

Analisis Deskriptif Statistik Volume Perdagangan Saham

Descriptive Statistics

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
VOL_SBLM t-5	43	,0000	,0171	,001521	,0032902
VOL_SSDH t+5	43	,0000	,0319	,002949	,0063286
Valid N (listwise)	43				



LAMPIRAN 5
Uji Normalitas Data

Uji Normalitas Data Return Saham

Tests of Normality

	Kolmogorov-Smirnov ^a			Shapiro-Wilk		
	Statistic	df	Sig.	Statistic	df	Sig.
R_SBLM t-5	,077	43	,200*	,965	43	,220
R_SSDH t+5	,082	43	,200*	,964	43	,200

Uji Normalitas Data Abnormal Return Saham

Tests of Normality

	Kolmogorov-Smirnov ^a			Shapiro-Wilk		
	Statistic	df	Sig.	Statistic	df	Sig.
AR_SBLM t-5	,088	43	,200*	,958	43	,120
AR_SSDH t+5	,083	43	,200*	,961	43	,150

Uji Normalitas Data Volume Perdagangan Saham

Tests of Normality

	Kolmogorov-Smirnov ^a			Shapiro-Wilk		
	Statistic	df	Sig.	Statistic	df	Sig.
VOL_SBLM t-5	,322	43	,000	,488	43	,000
VOL_SSDH t+5	,321	43	,000	,526	43	,000



LAMPIRAN 6
Uji Hipotesis

Uji Paired Sample T-Test Return Saham

Paired Samples Statistics

		Mean	N	Std. Deviation	Std. Error Mean
Pair 1	R_SBLM t-5	,053895	43	,6114967	,0932524
	R_SSDH t+5	,080528	43	,6237511	,0951211

Paired Samples Correlations

		N	Correlation	Sig.
Pair 1	R_SBLM t-5 & R_SSDH t+5	43	,957	,000

Paired Samples Test

		Paired Differences				t	df	Sig. (2-tailed)	
		Mean	Std. Deviation	Std. Error Mean	95% Confidence Interval of the Difference				
					Lower				Upper
Pair 1	R_SBLM t-5 - R_SSDH t+5	-,0266326	,1819531	,0277476	-,0826294	,0293643	-,960	42	,343

Uji Paired Sample T-Test Abnormal Return Saham

Paired Samples Statistics

		Mean	N	Std. Deviation	Std. Error Mean
Pair 1	AR_SBLM t-5	,056291	43	,6286396	,0958666
	AR_SSDH t+5	,081209	43	,6298709	,0960544

Paired Samples Correlations

		N	Correlation	Sig.
Pair 1	AR_SBLM t-5 & AR_SSDH t+5	43	,958	,000

Paired Samples Test

		Paired Differences					t	df	Sig. (2-tailed)
		Mean	Std. Deviation	Std. Error Mean	95% Confidence Interval of the Difference				
					Lower	Upper			
Pair 1	AR_SBLM t-5 - AR_SSDH t+5	-,0249186	,1828726	,0278878	-,0811985	,0313613	-,894	42	,377

Uji Wilcoxon Signed Rank Test Volume Perdagangan Saham

Ranks

		N	Mean Rank	Sum of Ranks
VOL_SSDH t+5 - VOL_SBLM t-5	Negative Ranks	9 ^a	8,39	75,50
	Positive Ranks	17 ^b	16,21	275,50
	Ties	17 ^c		
	Total	43		

- a. VOL_SSDH t+5 < VOL_SBLM t-5
- b. VOL_SSDH t+5 > VOL_SBLM t-5
- c. VOL_SSDH t+5 = VOL_SBLM t-5

Test Statistics^a

	VOL_SSDH t+5 - VOL_SBLM t-5
Z	-2,542 ^b
Asymp. Sig. (2-tailed)	,011

- a. Wilcoxon Signed Ranks Test
- b. Based on negative ranks.