

**LAPORAN PENELITIAN  
BIDANG BAHAN AJAR**



**ANALISIS PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP  
*RETURN SAHAM PERUSAHAAN UNGGULAN*  
DI BURSA EFEK INDONESIA**

**Oleh:  
Soekiyono  
Wiwin Siswantini**

**PUSAT PENELITIAN KELEMBAGAAN  
LEMBAGA PENELITIAN DAN PENGABDIAN PADA MASYARAKAT  
UNIVERSITAS TERBUKA  
2011**



**Halaman Pengesahan**  
**Proposal Penelitian Kelembagaan Universitas Terbuka**

1. a. Judul Penelitian : **Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return saham Perusahaan Unggulan di Bursa Efek Indonesia**
- b. Bidang Penelitian : Bahan Ajar
- c. Klasifikasi Penelitian : -
2. Ketua Peneliti
- a. Nama : Drs. Soekiyono, M.Si, MM
- b. NIP : 195407051986011001
- c. Pangkat/Golongan : Lektor Kepala/IVa
- d. Jabatan : Pembina
- e. Unit : Fakultas Ekonomi
- Anggota Peneliti
- a. Nama : Dra. Wiwin Siswanti, MM
- b. NIP : 196012181988032001
- c. Pangkat/Golongan : Lektor /IIIc
- d. Jabatan : Penata
- e. Unit : Fakultas Ekonomi
5. Lama Penelitian : 9 (sembilan) Bulan
6. Lokasi Penelitian : Tangerang Selatan
7. Tahun Pelaksanaan : 2011
8. Biaya Penelitian : 20.000.000 (Dua puluh juta rupiah)
9. Sumber Biaya : LPPM-Universitas Terbuka

Tangerang Selatan, 28 Desember 2011



Ketua Peneliti,

Drs. Soekiyono, M.Si, MM  
NIP.195407051986011001



Menyetujui,  
Kepala Pusat Keilmuan

Dra. Endang Nugraheni, M.Ed, MSi.  
NIP. 19570422198503 2 001



## ABSTRAK

Penelitian tentang Analisis Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham Perusahaan Unggulan Di Bursa Efek Indonesia, tujuannya untuk mengetahui terjadinya *Monday effect* pada perdagangan saham, untuk mengetahui terjadinya *weekend effect* pada perdagangan saham, untuk mengetahui pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder pada perusahaan unggulan (LQ 45) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia, masa periode Februari 2011 sampai dengan Juli 2011. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi non konstanta.

Berdasarkan hasil analisis data diperoleh kesimpulan sebagai berikut :

Pertama, rata-rata *return* saham pada hari Senin bernilai negatif yaitu sebesar -0,0038, artinya harga saham pada hari Senin mengalami penurunan, sehingga dapat disimpulkan terdapat pengaruh *Monday Effect*, yang mengakibatkan penurunan harga saham pada hari Senin.

Kedua, rata-rata *return* saham pada hari Jumat bernilai negatif yaitu sebesar -0,0035, artinya harga saham pada hari Jumat mengalami penurunan. *Weekend effect* terjadi jika rata-rata *return* pada hari Jumat positif. Dalam penelitian ini *return* saham pada hari Jumat bernilai negatif, hal ini menunjukkan tidak terdapat pengaruh *weekend effect*.

Ketiga, hari perdagangan yang berpengaruh signifikan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia adalah hari Rabu. Berdasarkan hasil analisis regresi dan uji F dapat disimpulkan tidak terdapat pengaruh hari perdagangan secara bersama-sama terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia.

**Kata kunci :** Hari perdagangan, *Monday Effect*, *weekend effect*



## KATA PENGANTAR

Puji dan syukur kami panjatkan kehadiran Allah SWT yang telah memberikan rahmat dan hidayah sehingga peneliti dapat menyelesaikan laporan penelitian yang berjudul “ Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Perusahaan Unggulan di Bursa Efek Jakarta “

Penelitian ini diharapkan dapat dijadikan masukan untuk materi studi kasus matakuliah pada modul Manajemen Keuangan di Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Terbuka. Selain itu harapan peneliti adalah dapat bermanfaat bagi institusi lain atau individu yang berkaitan dengan bidang ilmu Manajemen Keuangan:

Peneliti menyampaikan ucapan terima kasih kepada Drs. Yun Iswanto, M.Si selaku Dekan FEKON-UT, dan Dra. Endang Nugraheni, M.Ed, M.Si selaku Kepala Pusat Keilmuan LPPM-UT serta Drs. Agus Joko Purwanto, M.Si selaku Ketua LPPM-UT yang telah memberikan kesempatan kepada peneliti untuk melakukan penelitian ini.

Akhir kata, laporan penelitian ini merupakan buah pikiran peneliti yang tentunya masih jauh dari sempurna, sehingga perbaikan dan kritik membangun tetap peneliti perlukan untuk perbaikan di kemudian hari sebagai bagian dari proses belajar yang harus terus dilakukan.

Tangerang Selatan, 28 Desember 2011

Peneliti,





## DAFTAR ISI

	<b>Hal</b>
Halaman Pengesahan .....	i
Abstrak .....	ii
Kata Pengantar .....	iii
Daftar Isi .....	iv
Daftar Tabel .....	v
Daftar Gambar .....	vi
<b>Bab. I : Pendahuluan</b>	
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Perumusan Masalah .....	3
C. Pembatasan Masalah .....	3
D. Tujuan dan Kegunaan Penelitian .....	3
<b>Bab. II : Tinjauan Pustaka</b>	
A. Pasar Modal .....	5
B. Efisiensi Pasar .....	5
C. Anomali Pasar .....	7
D. Instrumen Pasar Modal .....	9
E. <i>Return</i> Saham .....	10
F. Investasi .....	11
G. Indeks LQ45 .....	12
H. Penelitian Terdahulu .....	13
I. Kerangka Penelitian .....	14
J. Hipotesis .....	16
<b>Bab. III : Metodologi Penelitian dan Analisis</b>	
A. Metodologi Penelitian .....	17
B. Metode Analisis .....	17
<b>Bab. IV Hasil dan Pembahasan</b>	
A. Hasil Penelitian .....	23
1. Diskripsi sampel .....	23
2. Diskripsi data penelitian .....	24
3. Asumsi Klasik .....	28
4. Pengujian Hipotesis .....	30
B. Pembahasan .....	36
<b>Bab. V Kesimpulan dan Implikasi</b>	
A. Kesimpulan .....	38
B. Implikasi .....	38
Daftar Pustaka .....	40
Rekomendasi Hasil Penelitian .....	42
Lampiran	

## DAFTAR TABEL

	<b>Hal</b>
Tabel 1. Daftar nama perusahaan yang masuk dalam LQ 45 Tahun 2011 .....	23
Table 2. Rata-rata <i>return</i> saham perusahaan yang masuk dalam LQ 45 tanggal Februari sampai dengan Juli tahun 2011 .....	24
Tabel 3. Frekuensi Hari Kerja di Bursa Efek Indonesia dari 2 Agustus sampai dengan 30 September tahun 2011 .....	26
Tabel 4. Statistik Diskriptif <i>Return</i> Saham tanggal 2 Agustus sampai dengan 30 September tahun 2011 .....	27
Tabel 5. Hasil penghitungan uji multikolinieritas .....	28
Tabel 6. Hasil penghitungan uji heteroskedastisitas .....	29
Tabel 7. Hasil perhitungan <i>Monday effect</i> .....	30
Tabel 8. Frekuensi Hari Kerja di Bursa Efek Indonesia dari tanggal 2 Agustus sampai dengan 30 September 2011 .....	32

UNIVERSITAS TERBUKA

## DAFTAR GAMBAR

	<b>Hal</b>
<b>Gambar 1.</b> Kerangka Pemikiran .....	15
<b>Gambar 2.</b> Kurva uji statistik Durbin-Watson .....	29
<b>Gambar 3.</b> Daerah penerimaan dan penolakan $H_0$ uji F .....	34
<b>Gambar 4.</b> Daerah penerimaan dan penolakan $H_0$ uji t .....	36

UNIVERSITAS TERBUKA



## I. PENDAHULUAN

### A. Latar Belakang Masalah

Globalisasi dengan terbentuknya peradaban modern secara tidak langsung akan menuntut segala sesuatunya serba cepat, tepat dan terpenuhi apa yang diinginkan. Dalam dunia ekonomi, segala kegiatan harus diperhitungkan efisiensinya termasuk faktor peluang, risiko dan keuntungan, termasuk dalam berinvestasi. Setiap keputusan investasi selalu menyangkut dua hal yaitu risiko dan *return*. Asumsi penting dalam risiko dan tingkat keuntungan yang diharapkan setiap individu adalah rasional dan tidak menyukai risiko atau *risk averter*. Sikap tidak menyukai risiko ini tercermin dari sikap bahwa setiap individu akan meminta tambahan keuntungan yang lebih besar untuk setiap kenaikan risiko yang dihadapi (Sartono, 1997:147)

Investasi adalah penundaan konsumsi sekarang untuk digunakan di dalam produksi yang efisien selama periode waktu yang tertentu. Dengan adanya kesempatan produksi yang efisien, penundaan konsumsi sekarang untuk diinvestasikan akan meningkatkan utilitas total (Jogiyanto, 1998:5). Bagi seorang calon investor yang rasional, perhatiannya akan diarahkan pada tingkat pengembalian (*return*) investasi dan investasi yang dipilih adalah yang menjanjikan *return* tertinggi dengan risiko tertentu. Karena investasi yang dilakukan mengandung unsur ketidakpastian, maka investor harus mempertimbangkan faktor risiko.

Dunia usaha sementara ini dibayangi dengan penuh ketidakpastian dari hasil yang diharapkan yang mungkin tidak sama dengan hasil yang diterima. Dengan demikian dalam setiap investasi mungkin akan menanggung risiko, yaitu kemungkinan bahwa hasil nyata berbeda dengan hasil yang diharapkan. Semakin besar perbedaan atau deviasi hasil ini, semakin besar pula risiko yang dikandung dalam investasi. Agar suatu investasi dapat diterima maka setiap kesempatan investasi harus menawarkan suatu tingkat hasil yang sepadan dengan risiko yang ditanggungnya (Muslich, 1997:14).

Kondisi dunia usaha yang akan terjadi penuh dengan ketidakpastian, maka manajemen perusahaan diasumsikan mengetahui dengan pasti investasi yang

dilakukannya, dan hasil atau *return* yang akan diperolehnya secara konseptual manajemen perusahaan hanya tinggal memilih suatu bentuk investasi yang menghasilkan hasil yang besar. Adanya ketidakpastian tentang keadaan di masa mendatang merupakan suatu karakteristik yang sebenarnya banyak dihadapi manajemen. Akibatnya adalah jarang sekali manajemen mempunyai suatu estimasi yang tepat tentang hasil investasinya. Dengan kata lain manajemen menanggung risiko atau ketidakpastian untuk menyatakan suatu keadaan dimana hasil tidak dinyatakan secara pasti tetapi probabilitas dari hasil yang diharapkan dapat diketahui. Distribusi probabilitas, yang menjelaskan tentang kemungkinan besarnya hasil, harus ditentukan agar dapat menjadi dasar estimasi dari hasil dan keputusan investasi yang akan datang (Muslich,1997:15).

Keputusan untuk berinvestasi perlu dipertimbangkan secara matang, terutama investasi di pasar modal. Hal ini disebabkan terdapat banyak faktor yang perlu diperhatikan sebelum memutuskan investasi. Salah satu faktor yang perlu diperhatikan dalam berinvestasi adalah hari perdagangan di pasar modal. Dari penelitian terdahulu yang dilakukan oleh Eduardus dan Algifari (1999) dapat diketahui bahwa ada hari perdagangan yang tidak berpengaruh terhadap *return*, yaitu hari Senin dan Kamis, sedangkan hari perdagangan yang berpengaruh terhadap *return* adalah hari Selasa, Rabu dan Jumat. Apabila investor ingin memaksimalkan *return* investasinya maka investor perlu memperhatikan hari perdagangan ini.

Penelitian sebelumnya tentang pengaruh Hari Senin terhadap *return* saham pernah dilakukan oleh Mills dan Coutts (1995) dalam Cahyadingdyah (2005), yang memperoleh kesimpulan *return* saham pada hari Senin lebih rendah dari pada *return* saham pada hari lainnya. Kato (1990) dalam Cahyadingdyah (2005) menemukan *return* terendah terjadi pada hari Selasa di Bursa Efek Jepang.

Perubahan harga saham akan meningkatkan probabilitas perolehan *return*. Perubahan harga saham seringkali terjadi pada perusahaan unggulan. Hal ini disebabkan perusahaan dengan saham unggulan menjadi tujuan investor untuk berinvestasi, sehingga frekuensi perdagangan saham pada perusahaan unggulan ini lebih tinggi dibandingkan dengan perusahaan lain. Frekuensi perdagangan yang tinggi menjadikan peluang berinvestasi yang lebih besar, karena sering terjadi aksi

jual dan beli. Jual dan beli ini berakibat pada perubahan harga yang pada akhirnya akan memunculkan *return* saham. Berdasarkan latar belakang masalah tersebut, penulis tertarik untuk melakukan penelitian dengan judul : **Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham Perusahaan Unggulan Di Bursa Efek Indonesia.**

## **B. Perumusan Masalah**

Berdasarkan latar belakang di atas, maka dirumuskan permasalahan sebagai berikut:

1. Bagaimana kecenderungan harga saham di Bursa Efek Indonesia pada awal pekan (*Monday effect*)?
2. Bagaimana kecenderungan harga saham di Bursa Efek Indonesia pada akhir pekan (*weekend effect*)?
3. Bagaimana pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia?

## **C. Pembatasan Masalah**

Penelitian ini dibatasi pada pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham dengan memperhatikan data yang ada. Saham yang diteliti adalah saham unggulan atau saham yang masuk dalam LQ 45 bulan Februari sampai dengan Juli 2011.

## **D. Tujuan dan Kegunaan Penelitian**

### **1. Tujuan Penelitian**

1. Untuk mengetahui kecenderungan yang terjadi harga saham di BEI pada awal pekan (*Monday effect*)
2. Untuk mengetahui kecenderungan harga saham di BEI yang terjadi pada akhir pekan (*weekend effect*)
3. Untuk mengetahui pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia.

## 2. Kegunaan Penelitian

- a. Penelitian ini diharapkan dapat memberikan gambaran tentang pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham.
- b. Dapat dijadikan informasi pada investor dan calon investor untuk mengetahui hari perdagangan yang mampu mempengaruhi *return* saham di Bursa Efek Indonesia khususnya *Return* Saham.
- c. Dapat dipergunakan sebagai referensi kepada Penulis Modul Manajemen Keuangan di Universitas Terbuka dan Penulis lainnya yang berkaitan dengan perdagangan saham.

UNIVERSITAS TERBUKA





## II. TINJAUAN PUSTAKA

### A. Pasar Modal

Pasar modal adalah tempat terjadinya transaksi asset keuangan jangka panjang atau *long-term financial assets* (Sartono: 1997:24). Pengertian lain pasar modal adalah suatu sistem keuangan yang terorganisasi (Sunariyah, 2000:4). Pasar modal mempunyai peranan penting dalam suatu negara, yang pada dasarnya peranan tersebut mempunyai kesamaan antara satu negara dengan negara yang lain. Peranan pasar modal antara lain (Sunariyah, 2000:7):

1. Sebagai fasilitas melakukan interaksi antara pembeli dan penjual untuk menentukan harga saham atau surat berharga yang diperjualbelikan. Ditinjau dari segi lain, pasar modal memberikan kemudahan dalam melakukan transaksi, sehingga kedua pihak dalam melakukan transaksi tanpa melalui tatap muka.
2. Pasar modal memberikan kesempatan kepada investor untuk memperoleh *return* yang diharapkan. Jadi pasar modal menciptakan peluang bagi perusahaan (emiten) untuk memuaskan keinginan investor melalui kebijakan dividen dan stabilitas harga sekuritas yang relatif normal.
3. Pasar modal memberi kesempatan kepada investor untuk menjual kembali saham yang dimilikinya.
4. Pasar modal menciptakan kesempatan kepada masyarakat untuk berpartisipasi dalam perkembangan suatu perekonomian.
5. Pasar modal mengurangi biaya informasi dan transaksi surat berharga, yang terdiri atas biaya pencarian dan biaya informasi.

### B. Efisiensi Pasar

Efisiensi pasar ditentukan oleh informasi yang tersedia. Informasi yang tercermin dalam harga saham akan menentukan bentuk pasar efisien. Secara teoritik dikenal tiga bentuk pasar yang efisien (Sunariyah, 2000:171), yaitu:

1. Efisiensi pasar bentuk lemah (*Weak-Form Market Efficiency*)  
Informasi yang dimaksud adalah data harga dan tingkat keuntungan (*return*) surat berharga di masa lampau.

1. Data harga (surat berharga) yang lampau tercermin secara penuh pada harga pasarnya (sekarang).
  2. *Excess return (abnormal return)* tidak akan dapat diperoleh berdasarkan pola harga yang lampau
2. Efisiensi pasar bentuk setengah kuat (*Semi-Strong-Form Market Efficiency*)
- Dasar bentuk ini adalah :
- a. Harga-harga surat berharga bereaksi penuh dan segera menyesuaikan atas semua informasi yang tersedia di masyarakat.
  - b. Hipotesisnya, bahwa penanaman modal tidak dapat memperoleh *excess return* berdasarkan informasi yang tersedia di masyarakat (*publicly available information*).
3. Efisiensi pasar bentuk kuat (*Strong-Form Market Efficiency*)
- Efisiensi pasar bentuk kuat menganggap :
- a. Harga-harga surat berharga sudah tercermin secara penuh atas semua informasi, apakah informasi tersebut tersedia di masyarakat atau tidak.
  - b. Sesuai dengan bentuk efisiensi pasar bentuk setengah kuat, bahkan pihak interen (*insider*) yang berhak untuk mengakses informasi tidak akan memperoleh *excess return*.

Berdasar penelitian dilakukan oleh para peneliti untuk mengetahui apakah suatu pasar modal pada kondisi *weak form*, *semi strong-form*, atau *strong form* dengan melakukan test empirik untuk menguji reaksi harga saham terhadap suatu informasi yang baru. Dalam hal ini metode yang digunakan adalah dengan cara melakukan *event studies*.

Secara umum karakteristik pasar modal efisien adalah sebagai berikut (Sunariyah, 2000:176) :

1. Harga saham akan merefleksikan secara cepat dan akurat terhadap semua bentuk informasi baru.
2. Harga saham bersifat *random*, jadi harga tidak mengikuti beberapa kecenderungan maupun informasi masa lalu untuk digunakan menentukan kecenderungan harga.

3. Saham-saham yang menguntungkan (*profitable*) tidak mudah untuk diprediksi, karena harga saham dipasar siap merefleksikan informasi yang akan datang. Jadi, para analis dan investor mempunyai kesiapan informasi penting dalam menentukan harga saham. Disamping itu, mereka tidak menggunakan informasi publikasi untuk memprediksi *return* atau *profit* dari pasar modal.

### C. Anomali Pasar

Anomali Pasar menunjukkan suatu fenomena yang terjadi berulang-ulang dan secara konsisten menyimpang dari kondisi pasar yang efisien (Jogiyanto, 2005:96). Beberapa anomali yang banyak mendapat perhatian adalah anomali karena strategi PER rendah (low P/E ratio), anomali efek ukuran perusahaan, anomali efek kalendar, dan anomali efek jangka panjang.

#### 1. PER rendah

Basu (1997) dalam Jogiyanto (2005:96).melakukan penelitian dengan merangking PER (*price/earning ratio*) dan membandingkan hasil dari grup PER tinggi dengan grup PER rendah selama 12 bulan setelah terjadi pembelian sekuritas. Hasil yang diperoleh menunjukkan bahwa sekuritas PER rendah mengalahkan sekuritas dengan PER tinggi.

Hasil tersebut dikatakan anomali karena informasi PER merupakan informasi yang tersedia lusa dan sudah banyak digunakan oleh pasar dalam menilai suatu sekuritas. Jika banyak investor menggunakan strategi ini, seharusnya strategi ini tidak akan menghasilkan abnormal return. Tetapi kenyataannya, strategi ini dapat menghasilkan abnormal return dengan pembelian sekuritas-sekuritas dengan PER rendah, sehingga dianggap sebagai suatu anomali.

#### 2. Efek Ukuran Perusahaan Kecil

Anomali pasar juga terjadi untuk ukuran perusahaan yang kecil. Banz (1981) dalam (Jogiyanto, 2005:96) menemukan bahwa perusahaan-perusahaan NYSE yang berukuran kecil memberikan *return* yang lebih besar dibandingkan dengan *return* yang diberikan oleh perusahaan besar.

### 3. Efek Kalender

Anomali ini terjadi karena waktu tertentu menghasilkan *return* yang lebih tinggi secara sistematis dan konsisten dibandingkan waktu yang lain. Anomali-anomali ini adalah efek waktu dalam hari (*time-of-the day effect*), efek hari dalam minggu (*day-of-the week effect*) dan efek bulan dalam tahun (*month-of the year effect*).

### 4. Efek Waktu Dalam Hari

Penelitian Aharis (1986) dalam (Jogiyanto, 2005:97) menunjukkan bahwa di NYSE harga saham-saham meningkat 30 menit sebelum pasar modal ditutup dan 45 menit pertama setelah pasar dibuka untuk hari Senin. Jika memang benar demikian, investor seharusnya menjual saham pada saat itu untuk mendapatkan keuntungan di atas normal. Jika semua orang melakukannya, keuntungan tersebut tidak akan terjadi. Kenyataannya, fenomena ini masih terjadi sehingga termasuk dalam kategori anomali, yaitu efek waktu dalam hari (*time-of the day effect*).

### 5. Efek Dari Dalam Minggu

Anomali yang terjadi pada hari-hari tertentu dalam satu minggu secara sistematis ini memberikan *return* yang lebih tinggi dibandingkan *return* yang dihasilkan pada hari-hari yang lain. Anomali ini disebut efek hari dalam minggu (*day-of the week effect*). Fenomena yang terjadi adalah *return* saham-saham pada hari Senin cenderung lebih rendah (disebut *blue Monday*) dan *return* saham-saham pada hari Jumat cenderung lebih tinggi dibandingkan *return* pada hari-hari lainnya.

### 6. Efek Bulan dan Tahun

Anomali yang terjadi pada hari-hari tertentu dalam satu minggu secara sistematis ini memberikan *return* yang lebih tinggi dibandingkan *return* yang dihasilkan pada bulan-bulan yang lainnya anomali ini disebut efek bulan dalam tahun (*month-of the year effect*) atau efek Januari (*January effect*)

### 7. Efek *Return* Jangka Panjang

Beberapa anomali pasar yang mengakibatkan penurunan dan peningkatan *return* jangka panjang antara lain adalah *return* jangka panjang negatif untuk IPO dan SOE, *return* jangka panjang negatif untuk merger, *return* jangka panjang positif untuk pemecahan saham, *return* jangka panjang untuk *tender offers* dan *stock*

*repurchases*, return jangka panjang negatif untuk *new listings*, return jangka panjang positif untuk *dividend initiations*, return jangka panjang negatif untuk *dividend omissions*, return jangka panjang positif untuk *spinoffs*, dan return jangka panjang negatif untuk *proxy-contest* (Jogiyanto, 2005:98) .

#### **D. Instrumen Pasar Modal**

Pasar modal menggunakan instrumen perdagangan berupa saham (Sumber: Anonim, 2000 <http://www.idx.co.id>). Instrumen tersebut dibedakan dalam saham biasa dan saham preferen, dengan penjelasan masing-masing instrumen sebagai berikut:

##### **1. Saham**

###### **a. Saham Biasa (*Common Stocks*)**

Di antara surat-surat berharga yang diperdagangkan di pasar modal, saham biasa (*common stock*) adalah yang paling dikenal masyarakat. Di antara emiten (perusahaan yang menerbitkan surat berharga), saham biasa juga merupakan yang paling banyak digunakan untuk menarik dana dari masyarakat. Jadi saham biasa paling menarik, baik bagi pemodal maupun bagi emiten. Apakah Saham itu, secara sederhana, saham dapat didefinisikan sebagai tanda penyertaan atau kepemilikan seseorang atau badan dalam suatu perusahaan. Wujud saham adalah, selebar kertas yang menerangkan bahwa pemilik kertas tersebut adalah pemilik perusahaan yang menerbitkan kertas tersebut. Jadi sama dengan menabung di bank. Setiap kali kita menabung, maka kita akan mendapat slip yang menjelaskan bahwa kita telah menyetor sejumlah uang. Bila kita membeli saham, maka kita akan menerima kertas yang menjelaskan bahwa kita memiliki perusahaan penerbit saham tersebut.

###### **b. Saham Preferen (*Preferred Stocks*)**

Saham Preferen merupakan saham yang memiliki karakteristik gabungan antara obligasi dan saham biasa, karena bisa menghasilkan pendapatan tetap (seperti bunga obligasi), tetapi juga bisa tidak mendapatkan hasil seperti yang dikehendaki investor. Saham preferen serupa dengan saham biasa karena dua hal, yaitu: mewakili kepemilikan

ekuitas dan diterbitkan tanpa tanggal jatuh tempo yang tertulis di atas lembaran saham tersebut dan membayar dividen.

Persamaan antara saham preferen dengan obligasi terletak pada tiga hal: 1) ada klaim atas laba dan aktiva sebelumnya, 2) dividennya tetap selama masa berlaku (hidup) dari saha, 3) memiliki hak tebus dan dapat dipertukarkan (*convertible*) dengan saham biasa. Oleh karena saham preferen diperdagangkan berdasarkan hasil yang ditawarkan kepada investor, maka secara praktis saham preferen dipandang sebagai surat berharga dengan pendapatan tetap dan karena itu akan bersaing dengan obligasi di pasar. Walaupun demikian, obligasi perusahaan menduduki tempat yang lebih senior dibanding dengan saham preferen.

## 2. Obligasi

Obligasi pada dasarnya merupakan surat pengakuan hutang atas pinjaman yang diterima oleh perusahaan penerbit obligasi dari masyarakat. Jangka Waktu obligasi telah ditetapkan dan disertai dengan pemberian imbalan bunga yang jumlah dan saat pembayarannya juga telah ditetapkan dalam perjanjian.

## 3. Derivatif dari Efek

Derivatif dari efek ini terdiri dari: *right*/klaim, waran, obligasi konvertibel, saham deviden dan saham bonus serta sertivikat reksadana. Menurut UU. No 8/1995 tentang pasar modal reksadana adalah wadah yang dipergunakan untuk menghimpun dana dari masyarakat pemodal, selanjutnya diinvestasikan dalam portofolio oleh manajer investasi.

## E. Return Saham

Tujuan para investor dalam menginvestasikan dananya adalah memperoleh *return* yang diharapkan secara maksimal pada tingkat risiko tertentu. Tujuan tersebut akan tercapai dengan berbagai upaya agar dana yang diinvestasikan bisa memberikan manfaat yang paling tinggi bagi investor. Oleh karena begitu pentingnya *return*, maka *return* merupakan kekuatan yang bisa memberikan motivasi dalam proses investasi.

Terdapat berbagai alternatif dalam pemilihan investasi diantaranya adalah; *return* yang dijanjikan merupakan obyek penilaian yang rasional. *Return* yang tinggi memberikan gambaran bahwa kompensasi yang diterima besar, demikian pula sebaliknya, *return* yang rendah memberikan gambaran bahwa kompensasi yang diterima kecil. Penilaian terhadap *return* tidak hanya terbatas pada *return* prediksi atau *return* yang diharapkan, tetapi juga pada *return* yang direalisasikan.

Dalam konsep *risk and return*, *return* dianggap mempunyai hubungan yang searah dengan risiko yang dihadapi oleh sebuah investasi. Semakin tinggi risiko yang ditanggung oleh investor, semakin tinggi *return* yang diharapkan oleh investor dari investasi tersebut. Apabila investasi dianggap tidak mengandung risiko, maka investor akan mengharap tingkat keuntungan sebesar tingkat keuntungan bebas risiko.

Investasi dalam saham dianggap merupakan investasi yang mengandung risiko. Risiko tersebut berasal dari adanya ketidakpastian *return* yang akan diterima oleh investor, sehingga dari saham yang dimiliki oleh investor diharapkan akan diperoleh suatu keuntungan yang lebih tinggi dibandingkan dengan keuntungan investor jika melakukan investasi bebas risiko.

## **F. Investasi**

Manusia dalam kegiatan ekonominya dihadapkan pada dua pilihan antara konsumsi dengan investasi. Dimana keduanya mempunyai konsekuensi dari aktivitas yang dipilihnya. Investasi menurut Jogiyanto (1998:5) adalah penundaan konsumsi sekarang untuk digunakan di dalam produksi yang efisien selama periode waktu yang tertentu. Investasi adalah penanaman modal untuk satu atau lebih aktiva yang dimiliki dan biasanya berjangka waktu lama dengan harapan mendapatkan keuntungan di masa-masa yang akan datang (Sunariyah, 2000:4).

Kegiatan penanaman atau investasi ini memerlukan pengatur yang profesional dan cakap, sehingga dapat berjalan sesuai harapan, dan biasanya dalam bentuk manajemen investasi. Manajemen investasi ini adalah proses pengelolaan uang (Fabozzi, 1999:1). Sementara individu yang melakukan pengelolaan portofolio investasi disebut manajer investasi, manajer keuangan atau manajer portofolio.



Portofolio sendiri diartikan sebagai sekelompok bentuk investasi. Investasi dalam keuangan dapat dibedakan ke dalam dua tipe yaitu investasi langsung yaitu pembelian langsung aktiva keuangan suatu perusahaan dan investasi tidak langsung yaitu pembelian saham dari perusahaan investasi yang mempunyai portofolio aktiva-aktiva keuangan dari perusahaan-perusahaan lain (Jogiyanto, 1998:6).

#### 1. Investasi langsung

Investasi ini biasanya dilakukan di pasar uang (*money market*), pasar modal, atau pasar turunan dalam bentuk aktiva keuangan yang dapat diperjual belikan. Itemnya adalah aktiva yang mempunyai risiko kecil, jauh temponya pendek dengan tingkat cair yang tinggi. Contohnya adalah *treasury-bill* (T-bill) yang banyak digunakan di penelitian keuangan sebagai proksi *return* bebas risiko (*risk-free rate of return*), sertifikat deposito yang dapat dinegosiasikan/dapat dijual kembali (Jogiyanto, 1998:7).

#### 2. Investasi tidak langsung

Investasi ini dilakukan dengan membeli surat-surat berharga dari perusahaan investasi. Perusahaan investasi adalah perusahaan yang menyediakan jasa keuangan dengan cara menjual sahamnya ke publik dan menggunakan dana yang diperoleh untuk diinvestasikan ke dalam portofolionya. Klasifikasi portofolio adalah *unit investment trust* merupakan *trust* yang menerbitkan portofolio yang dibentuk dari surat-surat berharga berpenghasilan tetap (misalnya *bond*) dan ditangani oleh orang kepercayaan yang independen. Perusahaan investasi ini masih menjual saham baru kepada investor setelah penjualan saham perdananya dan pemegang saham dapat menjual kembali sahamnya ke perusahaan reksa dana bersangkutan (Jogiyanto, 1998:9).

### G. Indeks LQ45

Indeks ini terdiri dari 45 saham dengan likuiditas (*Liquid*) tinggi, yang diseleksi melalui beberapa kriteria pemilihan. Selain penilaian atas likuiditas, seleksi atas saham-saham tersebut mempertimbangkan kapitalisasi pasar. Untuk dapat masuk dalam pemilihan, suatu saham harus memenuhi kriteria-kriteria berikut ini:

1. Masuk dalam urutan 60 terbesar dari total transaksi saham di Pasar Reguler (rata-rata nilai transaksi selama 12 bulan terakhir).
2. Urutan berdasarkan kapitalisasi pasar (rata-rata nilai kapitalisasi pasar selama 12 bulan terakhir).
3. Telah tercatat di BEI selama paling sedikit 3 bulan.

Bursa Efek Indonesia secara rutin memantau perkembangan kinerja komponen saham yang masuk dalam penghitungan Indeks LQ45. Penggantian saham akan dilakukan setiap enam bulan sekali, yaitu pada awal bulan Februari dan Agustus. Apabila terdapat saham yang tidak memenuhi kriteria seleksi Indeks LQ 45, maka saham tersebut dikeluarkan dari penghitungan indeks dan diganti dengan saham lain yang memenuhi kriteria.

Hari Dasar Indeks LQ45 pertama kali diluncurkan pada tanggal 24 Februari 1997. Hari dasar untuk penghitungannya adalah 13 Juli 1994 dengan nilai dasar 100. Untuk seleksi awal digunakan data pasar dari Juli 1993 - Juni 1994, hingga terpilih 45 emiten yang meliputi 72% dari total kapitalisasi pasar dan 72,5% dari total nilai transaksi di pasar reguler.

#### H. Penelitian Terdahulu

1. Robiyanto (2000) melakukan penelitian dengan judul Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap *Return* Harian Saham Di Bursa Efek Jakarta. Penelitian ini berusaha menjelaskan pengaruh hari perdagangan saham terhadap sebelas indeks harga saham yang ada di Bursa Efek Jakarta, yaitu IHSG, LQ 45, Indeks Harga Sektoral (Pertanian, Pertambangan, Industri Dasar, Aneka Industri, Industri Konsumsi, Properti, Infrastruktur, Keuangan dan Perdagangan) dengan metode Arima (*Autoregressive Integrated Moving Average*) guna menghindari pelanggaran terhadap aturan-aturan regresi OLS. Hasil penelitian ini adalah tidak terdapat pengaruh hari perdagangan saham terhadap *return* saham sektor pertanian, pertambangan, dan aneka industri. Hari Senin berpengaruh negatif terhadap *return* saham sektor properti dan keuangan. Hari Rabu berpengaruh negatif terhadap *return* saham unggulan (LQ 45), Hari Kamis berpengaruh positif terhadap *return* pasar unggulan, sektor industri dasar, industri konsumsi, properti,

infrastruktur, keuangan dan perdagangan. Dari hasil pengujian perbedaan *return* tidak ditemukan adanya perbedaan *return* setiap hari perdagangan pada IHSG, sektor pertanian, pertambangan, industri konsumsi, infrastruktur, keuangan dan perdagangan. Perbedaan *return* setiap hari terjadi pada saham LQ 45, industri dasar, aneka industri dan properti.

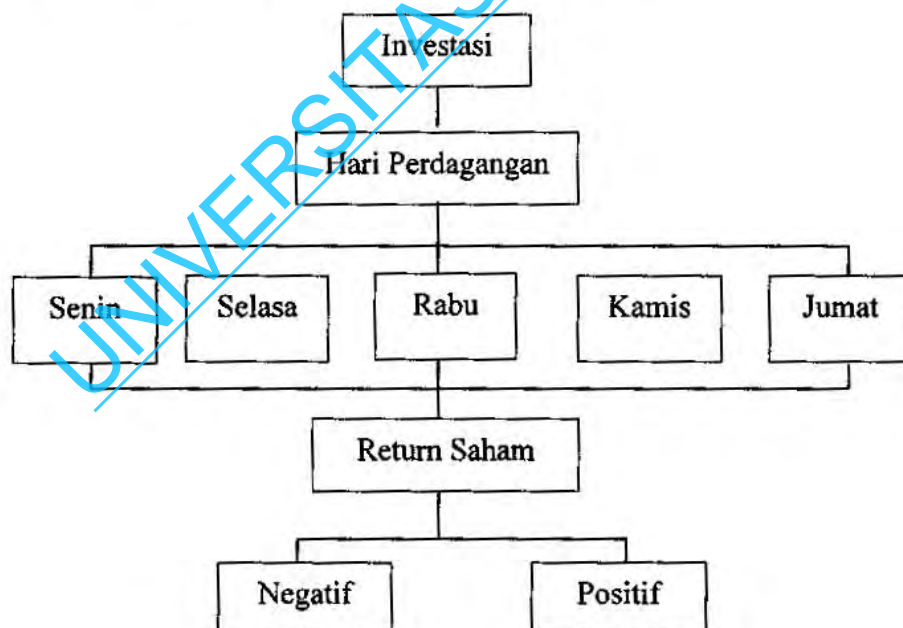
2. Dwi Cahyadingdyah (2005) melakukan penelitian dengan judul "Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham: Pengujian Week-Four Effect dan Rogalski Effect di Bursa Efek Jakarta. Penelitian ini mengambil 73 saham yang aktif diperdagangkan di Bursa Efek Jakarta. Periode penelitian mulai dari tahun 2001 sampai dengan tahun 2003. Hasil pengujian menunjukkan terdapat pengaruh hari perdagangan terhadap *return* pada hari Senin, Rabu, Kamis dan Jumat. Hasil pengujian *week four effect* dapat diketahui Senin pertama sampai Senin kelima memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return*. Hasil pengujian *Rogalski effect* dapat diketahui terdapat pengaruh hari Senin, Selasa Rabu dan Jumat terhadap *return*.
3. Joko Sangaji (2005) melakukan penelitian dengan judul Efek Hari dalam seminggu pada Imbal hasil saham PT Aneka Tambang Tbk. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji adanya efek hari dalam seminggu pada *return* saham di PT Aneka Tambang Tbk dari tanggal 27 November tahun 1997 sampai dengan 31 Maret tahun 2005. Dari hasil analisis OLS dapat disimpulkan hari Selasa dan Kamis berpengaruh signifikan terhadap *return*, sedangkan hari lainnya tidak berpengaruh signifikan.

## **I. Kerangka Penelitian**

Fenomena bisa terjadi bila *return* harian rata-rata tidak sama untuk semua hari dalam satu minggu, sementara menurut teori pasar yang efisien, *return* saham akan tidak berbeda berdasar perbedaan hari perdagangan. Hasil penelitian sebelumnya menunjukkan adanya *return* negatif untuk hari Senin yang disebut *Monday Effect* dan *return* positif tertinggi terjadi pada hari Jumat yang disebut *weekend effect* (Cahyaningdyah, 2005).

Aktivitas perdagangan saham berubah dari hari ke hari. Perubahan ini disebabkan oleh perubahan perilaku investor dalam melakukan aktivitas perdagangan di bursa. Indikator aktivitas perdagangan di bursa misalnya banyaknya transaksi dan volume perdagangan berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham di pasar modal. Kamalh, Chakornpipat dan Chatrath (1998) dengan menggunakan metode GARCH (*Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity*) untuk meneliti distribusi *return* harian dan *Day of the Week Effect* di *Thailand Stock Echange* menemukan hasil yang sama dengan penelitian terdahulu di Bursa Saham Amerika bahwa terdapat *return* yang terendah di hari Senin dan *return* tertinggi di hari Jumat.

Adanya perbedaan *return* harian di berbagai bursa di dunia maka dalam penelitian ini dianalisis tentang *return* saham harian, dalam periode harian dan mingguan. Berdasarkan uraian kerangka pemikiran maka digambarkan bagan kerangka pemikiran seperti tercantum pada gambar 1.



Gambar 1. Kerangka Pemikiran

## **J. Hipotesis**

1. Harga saham di Bursa Efek Indonesia pada awal pekan cenderung turun sehingga mengakibatkan *return* saham terendah pada awal pekan
2. Harga saham di Bursa Efek Indonesia pada akhir pekan cenderung naik sehingga mengakibatkan *return* saham tertinggi pada akhir pekan
3. Terdapat pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia.

UNIVERSITAS TERBUKA



### III. METODE PENELITIAN DAN ANALISIS

#### A. Metode Penelitian

##### 1. Jenis penelitian

Penelitian ini merupakan studi kasus tentang *return* saham harian di Bursa Efek Indonesia.

##### 2. Sasaran Penelitian

Sasaran penelitian ini adalah perusahaan yang masuk dalam daftar saham unggulan (LQ 45) di Bursa Efek Indonesia pada periode Februari sampai dengan Juli tahun 2011.

##### 3. Obyek Penelitian

Obyek yang diteliti adalah *return* saham unggulan (indeks LQ 45).

##### 4. Jenis Data

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan data sekunder, yaitu data yang diperoleh dari dokumentasi harga saham dan indeks harga saham di Bursa Efek Indonesia.

##### 5. Populasi

Populasi yang diteliti dalam penelitian ini adalah perusahaan yang masuk dalam daftar saham unggulan (LQ 45) di Bursa Efek Indonesia pada awal tahun 2011 yaitu sebanyak 45 saham teraktif.

##### 6. Sampel

Pengambilan sampel dilakukan dengan menggunakan metode sampling jenuh (*saturation sampling*), yaitu semua anggota populasi dijadikan obyek penelitian, sehingga ukuran sampel penelitian ini adalah 45 perusahaan unggulan.

#### B. Metode Analisis

##### 1. Definisi Operasional

###### a. Hari perdagangan

Hari perdagangan yang dimaksudkan dalam penelitian ini adalah hari kerja di bursa (pasar modal) yang pada hari tersebut diperdagangkan secara aktif saham-saham perusahaan yang terdaftar di bursa efek. Hari kerja efektif

dalam satu minggu adalah lima hari kerja yaitu Senin sampai Jum'at, kecuali terdapat hari libur nasional atau cuti bersama pada hari-hari tersebut

b. *Return* saham

*Return* saham yang dimaksudkan dalam penelitian ini adalah persentase perubahan saham antara saham pada periode ke-t dengan saham periode sebelumnya (t-1). *Return* saham yang digunakan pada penelitian ini adalah *return* saham harian yang dihitung atas dasar harga penutupan pada setiap hari. Rumusnya adalah (Jogiyanto, 1998:86):

$$R_{it} = \frac{P_{it} - P_{it-1}}{P_{it-1}}$$

Keterangan:

$P_t$  = Harga saham pada waktu ke t

$P_{t-1}$  = Harga saham pada waktu sebelumnya t.

2. Pengujian hipotesis pertama dan kedua dilakukan dengan metode rata-rata *return* dengan rumus sebagai berikut (Supranto, 2001:68):

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n Xi$$

Keterangan :

X = *Return*

n = Ukuran sampel

Hipotesis pertama diterima jika rata-rata *return* awal pekan terendah

Hipotesis pertama ditolak jika rata-rata *return* awal pekan tidak terendah

Hipotesis kedua diterima jika rata-rata *return* akhir pekan tertinggi

Hipotesis kedua ditolak jika rata-rata *return* akhir pekan tidak tertinggi

3. Uji Asumsi Klasik

a. Uji Multikolinieritas

Uji multikolinieritas bertujuan untuk menguji korelasi antar variabel bebas (*independent*). Model regresi yang baik seharusnya tidak terjadi



korelasi antar variabel bebas. Selain itu gejala multikolinieritas juga dapat dideteksi dengan mengamati hasil analisis regresi dengan menggunakan SPSS for windows, yaitu pada nilai *tolerance value* atau *variance inflation factor* (VIF). Batas *tolerance value* adalah 0,10 dan batas VIF adalah 5. Jika *tolerance value* di bawah 0,10 atau nilai VIF di atas 5 maka dapat dipastikan telah terjadi multikolinieritas (Santoso, 2001:357).

b. Uji Heteroskedastisitas

Heteroskedastisitas merupakan suatu kondisi dalam mana faktor gangguan tidak memiliki varian yang sama atau tidak konstan. Pengujian untuk menyelidiki adanya heteroskedastisitas dapat dilakukan dengan uji Gleyser (Gujarati, 1997:187) dengan cara sebagai berikut:

- 1) Menghitung nilai residual atau kesalahan pengganggu dari persamaan regresi kemudian nilai residual tersebut diabsolutkan.
- 2) Melakukan regresi antara nilai absout ( $e_i$ ) dengan tiap-tiap variabel independen dengan model sebagai berikut:

$$e_i = \alpha + \beta X_i + v_i$$

- 3) Apabila semua variabel independen signifikan secara statistik, maka dalam model tersebut terdapat heteroskedastisitas.

Selain itu gejala heteroskedastisitas dapat dideteksi dengan menggunakan SPSS for windows, yaitu pada nilai *p value* variabel yang diuji. Jika *p value* di bawah 0,05 maka dapat disimpulkan telah terjadi heteroskedastisitas.

c. Uji Autokorelasi

Salah satu masalah penting yang mungkin terjadi pada analisis regresi adalah autokorelasi. Asumsi autokorelasi menyebutkan bahwa pengamatan yang terjadi pada satu titik waktu berhubungan dengan pengamatan lainnya. Asumsi yang harus dipenuhi adalah tidak terjadi autokorelasi. Hal ini mengandung maksud bahwa bila pengamatan dilakukan sepanjang waktu maka pengaruh faktor pengganggu yang terjadi tidak terbawa ke periode lainnya. Untuk mengetahui adanya autokorelasi digunakan statistik-d Durbin Watson (Gujarati, 1997:215):

$$d = \frac{\sum_{t=2}^n (e_t - e_{t-1})^2}{\sum_{t=1}^n e_t^2}$$

Keterangan :

d = d-Durbin Watson

$e_t$  = kesalahan pengganggu

Kriteria:

Kurang dari DL	:	Ada autokorelasi positif
Antara DL dan DU	:	Tanpa kesimpulan
Antara DU dan 4-DU	:	Tidak ada autokorelasi
Antara 4-DU dan 4-DL	:	Tanpa kesimpulan
>4-DL	:	Ada autokorelasi negatif
DL	:	Batas bawah durbin watson
DU	:	Batas atas durbin Watson.

### 3. Analisis Regresi

Untuk menguji hipotesis ketiga digunakan analisis regresi tanpa konstanta dengan model sebagai berikut (Supranto, 2001:237):

$$R_t = a_1M + a_2T_2 + a_3W + a_4Th + a_5F + e$$

Keterangan :

$R_t$  = Return pada periode ke t

M = Hari Senin (Jika Hari Senin 1, Jika tidak Hari Senin 0)

T = Hari Selasa (Jika Hari Selasa 1, Jika tidak Hari Selasa 0)

W = Hari Rabu (Jika Hari Rabu 1, Jika tidak Hari Rabu 0)

Th = Hari Kamis (Jika Hari Kamis 1, Jika tidak Hari Kamis 0)

F = Hari Jumat (Jika Hari Jumat 1, Jika tidak Hari Jumat 0)

$a_1 \dots a_5$  = Koefisien regresi

e = Kesalahan pengganggu.

#### 4. Uji F

Untuk menguji pengaruh secara bersama-sama digunakan uji F dengan rumus (Supranto J, 2001:258) sebagai berikut :

$$F = \frac{R^2/(k)}{(1-R^2)/(n-k-1)}$$

Keterangan:

F = F hitung

k = Banyaknya variabel bebas

$R^2$  = Koefisien determinasi

n = Ukuran sampel

Perumusan Hipotesis:

$H_0 : b = 0$  Tidak ada pengaruh dari variabel bebas terhadap variabel terikat secara simultan

$H_a$  : Paling sedikit terdapat satu koefisien  $b \neq 0$   
Sekurang-kurangnya terdapat satu variabel bebas yang berpengaruh diantara variabel bebas terhadap variabel terikat secara simultan.

Kriteria pengujian hipotesis:

Dengan derajat kebebasan atau df (k-1) : (n-k) dan tingkat keyakinan 95% *level of significance*  $\alpha = 0.05$  maka:

$H_0$  diterima apabila F hitung  $\leq$  F tabel,

$H_0$  ditolak apabila F hitung  $>$  F tabel.

#### 5. Uji t

Untuk menguji pengaruh hari kerja terhadap *return* saham secara parsial digunakan uji t dengan rumus (Supranto J, 2001:276)

$$t_0 = \frac{b_j}{sb_j}$$

Keterangan:

$t_0$  = t hitung

$b_j$  = Koefisien regresi

$sb_j$  = Kesalahan baku dari koefisien regresi

Perumusan Hipotesis :

$H_0 : b_j = 0$  Tidak ada pengaruh dari variabel bebas terhadap variabel terikat secara parsial

$H_a : b_j \neq 0$  Ada pengaruh dari variabel bebas terhadap variabel terikat secara parsial

Kriteria Pengujian Hipotesis:

Dengan menggunakan derajat kebebasan (  $n - k$  ) tingkat keyakinan 95% dan tingkat kesalahan  $\alpha = 0,05$  , maka:

$H_0$  diterima apabila  $-t \text{ tabel} \leq t \text{ hitung} \leq t \text{ tabel}$

$H_0$  ditolak apabila  $t \text{ hitung} < -t \text{ tabel}$  atau  $t \text{ hitung} > t \text{ tabel}$

UNIVERSITAS TERBUKA



#### IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

##### A. Hasil Penelitian

##### 1. Diskripsi Sampel

Penelitian ini meneliti pengaruh hari perdagangan terhadap *return* saham perusahaan yang masuk dalam indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2011. Berdasarkan metode penentuan ukuran sampel diperoleh 45 perusahaan sampel. Perusahaan sampel tersebut dapat dilihat pada tabel 1 sebagai berikut :

Tabel 1. Daftar nama perusahaan yang masuk dalam LQ 45 Tahun 2011

No	Kode	Nama Perusahaan
1	AALI	PT. Astra Agro Lestari Tbk
2	ADRO	PT. Adaro Energy Tbk
3	ANTM	PT. Aneka Tambang Tbk
4	ASHI	PT. Astra International Tbk
5	ASRI	PT. Alam Sutera Realty Tbk
6	BBCA	PT. Bank Central Asia Tbk
7	BBKP	PT. Bank Bukopin Tbk
8	BBNI	PT. Bank Negara Indonesia Tbk
9	BBRI	PT. Bank Rakyat Indonesia Tbk
10	BBTN	PT. Bank Tabungan Negara Tbk
11	BDMN	PT. Bank Danamon Indonesia Tbk
12	BJBR	PT. BPD Jawa Barat Tbk
13	BMRI	PT. Bank Mandiri Tbk
14	BNBR	PT. Bakrie & Brothers Tbk
15	BRAU	PT. Berau Coal Energy Tbk
16	BSDE	PT. Bumi Serpong Damai Tbk
17	BTEL	PT. Bakrie Telecom Tbk
18	BUMI	PT. Bumi Resources Tbk
19	CPIN	PT. Charoen Pokphand Indonesia Tbk
20	DOID	PT. Delta Dunia Makmur Tbk
21	ELSA	PT. Elnusa Tbk
22	ELTY	PT. Bakrieland Development Tbk
23	ENRG	PT. Energi Mega Persada Tbk
24	GGRM	PT. Gudang Garam Tbk
25	GJTL	PT. Gajah Tunggal Tbk
26	INCO	PT. International Nickel Indonesia Tbk
27	INDF	PT. Indofood Sukses Makmur Tbk
28	INDY	PT. Indika Energy Tbk

29	INTP	PT. Indocement Tunggul Prakarsa Tbk
30	ISAT	PT. Indosat Tbk
31	ITMG	PT. Indotambang Raya Megah Tbk
32	JSMR	PT. Jasamarga Tbk
33	KLBF	PT. Kalbe Farma Tbk
34	LPKR	PT. Lippo Karawaci Tbk
35	LSIP	PT. PP London Sumatra Indonesia Tbk
36	MEDC	PT. Medco Energi Internasional Tbk
37	PGAS	PT. Perusahaan Gas Negara Tbk
38	PTBA	PT. Tambang Batubara Bukit Asam Tbk
39	SMCB	PT. Holcim Indonesia Tbk
40	SMGR	PT. Semen Gresik Tbk
41	TINS	PT. Timah Tbk
42	TLKM	PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk
43	UNSP	PT. Bakrie Sumatera Plantations Tbk
44	UNTR	PT. United Tractors Tbk
45	UNVR	PT. Unilever Indonesia Tbk

## 2. Diskripsi Data Penelitian

### a. Return Saham

Penelitian ini bertujuan untuk meneliti *return* saham pada tiap hari perdagangan. Diskripsi data *return* saham dapat dilihat pada tabel 2.

Tabel 2. Rata-rata *return* saham perusahaan yang masuk dalam LQ 45 tanggal Februari sampai dengan Juli tahun 2011

No	Perusahaan	Senin	Selasa	Rabu	Kamis	Jumat
1	AAJI	-0,0108	-0,0029	0,7367	-0,1039	-0,0115
2	ADRO	-0,0235	0,0021	0,0140	-0,0175	-0,0271
3	ANTM	-0,0175	-0,0010	-0,0014	-0,0141	-0,0038
4	ASII	0,0004	0,0416	-0,0221	-0,0070	-0,0189
5	ASRI	-0,0082	0,0008	0,0080	-0,0057	-0,0085
6	BBCA	-0,0114	0,0087	-0,0052	-0,0071	0,0013
7	BBKP	-0,0211	0,0014	-0,0036	-0,0158	-0,0143
8	BBNI	-0,0079	-0,0048	0,0043	-0,0183	0,0033
9	BBRI	-0,0182	0,0075	0,0037	-0,0104	-0,0070
10	BBTN	-0,0187	-0,0014	0,0009	-0,0202	-0,0034
11	BDMN	-0,0118	-0,0040	0,0095	-0,0126	-0,0001
12	BJBR	-0,0131	0,0063	-0,0017	-0,0165	-0,0138
13	BMRI	-0,0160	0,0035	0,0021	-0,0132	-0,0050
14	BNBR	-0,0195	0,0027	-0,0044	-0,0025	-0,0179

15	BRAU	-0,0087	0,0029	0,0061	-0,0179	-0,0087
16	BSDE	-0,0268	0,0022	0,0058	0,0027	-0,0094
17	BTEL	-0,0023	-0,0086	0,0000	0,0254	-0,0205
18	BUMI	-0,0304	0,0082	-0,0011	-0,0275	-0,0081
19	CPIN	-0,0203	0,0330	0,0115	-0,0254	-0,0068
20	DOID	-0,0217	0,0108	0,0093	-0,0063	-0,0284
21	ELSA	-0,0113	-0,0037	0,0028	-0,0215	-0,0118
22	ELTY	-0,0227	0,0066	-0,0019	-0,0196	-0,0177
23	ENRG	-0,0287	0,0063	-0,0099	-0,0264	-0,0270
24	GGRM	-0,0107	0,0081	0,0010	-0,0012	0,0020
25	GJTL	-0,0221	0,0034	0,0209	-0,0075	-0,0204
26	INCO	-0,0143	-0,0055	-0,0007	0,0202	-0,0011
27	INDF	-0,0140	0,0030	-0,0057	-0,0162	0,0042
28	INDY	-0,0244	0,0006	1,2768	-0,1326	-0,0156
29	INTP	0,0038	0,0027	-0,0016	-0,0179	0,0051
30	ISAT	-0,0030	-0,0032	0,0039	0,0099	-0,0132
31	ITMG	-0,0095	0,0037	0,1185	0,8814	0,2735
32	JSMR	-0,0062	0,0167	0,0069	-0,0118	-0,0037
33	KLBF	0,0465	-0,0356	0,0164	-0,0151	-0,0004
34	LPKR	-0,0197	0,0082	0,0046	-0,0055	-0,0153
35	LSIP	-0,0094	0,0091	-0,0029	-0,0086	-0,0055
36	MEDC	-0,0082	0,0105	0,0018	-0,0116	-0,0096
37	PGAS	-0,0175	0,0113	0,0017	-0,0218	-0,0207
38	PTBA	-0,0105	-0,0069	0,0074	-0,0098	-0,0084
39	SMCB	-0,0092	0,0016	0,0059	-0,0110	-0,0070
40	SMGR	0,0004	-0,0022	0,0004	-0,0109	-0,0016
41	TINS	-0,0195	0,0030	0,0062	-0,0068	-0,0225
42	TLKM	0,0002	-0,0025	0,0047	0,0016	-0,0002
43	UNSP	-0,0252	0,0129	-0,0044	-0,0137	-0,0234
44	UNTR	-0,0030	-0,0020	0,0047	-0,0124	-0,0128
45	UNVR	0,3762	-0,0921	0,0071	0,0062	0,0049
	Minimal	-0,0304	-0,0921	-0,1185	-0,1326	-0,0284
	Maksimal	0,3762	0,0416	1,2768	0,8814	0,2735
	Jumlah	-0,1700	0,0631	2,0002	0,1829	-0,1570
	Data (n)	45	45	45	45	45
	Rata-rata	-0,0038	0,0014	0,0444	0,0041	-0,0035
	S. Deviasi	0,0592	0,0179	0,2185	0,1360	0,0432
	Rata-rata Keseluruhan					0,0085



Berdasarkan tabel 2 dapat diketahui *return* saham berkisar antara -0,1326 persen sampai dengan 1,2768 persen dengan rata-rata 0,0085 persen. Nilai *return* negatif menunjukkan adanya penurunan harga saham, sedangkan nilai *return* positif menunjukkan adanya peningkatan harga saham. Peningkatan harga saham menunjukkan investor memperoleh keuntungan dari selisih harga saham (*capital gain*), sedangkan penurunan harga saham menunjukkan investor memperoleh kerugian (*capital loss*). Rata-rata *return* minimal terjadi pada saham INDY sebesar -0,1326 persen, sedangkan rata-rata *return* maksimal terjadi pada saham INDY sebesar 1,2768

b. Hari Perdagangan

Penelitian ini dilakukan terhadap perusahaan yang termasuk dalam LQ 45 Tahun 2011. Periode penelitian adalah tanggal 2 Agustus sampai dengan 30 September Tahun 2011 atau sebanyak 38 hari kerja di Bursa Efek Indonesia. Dari 38 hari kerja tersebut dapat dirinci frekuensi hari kerja selama satu pekan seperti tercantum pada tabel 3.

Tabel 3. Frekuensi Hari Kerja di Bursa Efek Indonesia dari 2 Agustus sampai dengan 30 September tahun 2011

No	Hari	Frekuensi	Tanggal
1	Senin	7	[Agustus: 8;15;22] [September : 5;12;19;26]
2	Selasa	8	[Agustus: 2;9;16;23] [September : 6;13;20;27]
3	Rabu	7	[Agustus: 3;10;24] [September : 7;14;21;28]
4	Kamis	8	[Agustus: 4;11;18;25] [September : 8;15;22;29]
5	Jumat	8	[Agustus: 5;12;19;16] [September : 9;16;23;30]
Total		38	

Sumber : Lampiran 3

Berdasarkan tabel 3 dapat diketahui selama periode tanggal 2 Agustus sampai dengan 30 September tahun 2011 frekuensi Hari Senin sebanyak 7 kali, Hari Selasa sebanyak 8 kali, Hari Rabu sebanyak 7 kali, Hari Kamis sebanyak 8 kali dan Hari Jumat sebanyak 8 kali. Perbedaan ini disebabkan adanya hari libur nasional yang terjadi selama tanggal 2 Agustus sampai

dengan 30 September Tahun 2011 pada hari-hari kerja di Bursa Efek Indonesia.

Setelah didiskripsikan setiap variabel, selanjutnya didiskripsikan *return* setiap hari dalam satu pekan hari perdagangan di Bursa Efek Indonesia seperti tercantum pada tabel 4.

Tabel 4. Statistik Diskriptif *Return* Saham tanggal 2 Agustus sampai dengan 30 September tahun 2011

No	Hari	Min	Max	Rata-rata	S. D.	Observasi
1	Senin	-0,0304	0,3762	-0,0038	0,0592	7
2	Selasa	-0,0921	0,0416	0,0014	0,0179	8
3	Rabu	-0,1185	1,2768	0,0444	0,2185	7
4	Kamis	-0,1326	0,8814	0,0041	0,1360	8
5	Jumat	-0,0284	0,2735	-0,0035	0,0432	8

Sumber : tabel 3

Berdasarkan tabel 4 dapat diketahui *return* pada Hari Senin berkisar antara -0,0304 sampai dengan 0,3762 dengan rata-rata -0,0038. Hal ini menunjukkan *return* saham pada hari Senin cenderung negatif atau terjadi penurunan harga saham pada hari Senin, yaitu dengan rata-rata -0,0038. Adanya *return* rendah pada awal pekan menunjukkan adanya *Monday Effect*, yaitu *return* pada awal pekan yaitu pada hari Senin cenderung negatif.

Pada hari Selasa, Rabu, dan Kamis rata-rata *return* positif, yaitu pada hari Selasa sebesar 0,0014, Hari Rabu sebesar 0,0444, dan Hari Kamis sebesar 0,0041. Rata-rata *return* tersebut cenderung mengalami peningkatan. Hal ini menunjukkan pada Hari Selasa, Rabu dan Kamis harga saham cenderung mengalami peningkatan, sehingga mengakibatkan rata-rata *return* bernilai positif. Pada hari Jumat diketahui nilai rata-rata *return* negatif, yaitu sebesar -0,0035. Adanya *return* negatif pada akhir pekan menunjukkan adanya pengaruh *weekend effect* yaitu harga saham pada akhir pekan cenderung mengalami penurunan, dan penurunan tertinggi terjadi pada hari Senin, yaitu dengan rata-rata penurunan sebesar 0,38 persen.

### 3. Asumsi Klasik

#### a Uji Multikolinieritas

Uji multikolinieritas bertujuan untuk menguji korelasi antar variabel bebas (*independent*). Model regresi yang baik seharusnya tidak terjadi korelasi antar variabel bebas. Selain itu gejala multikolinieritas juga dapat dideteksi dengan mengamati hasil analisis regresi dengan menggunakan SPSS *for windows*, yaitu pada nilai *tolerance value* atau *variance inflation factor* (VIF). Batas *tolerance value* adalah 0,10 dan batas VIF adalah 5. Jika *tolerance value* di bawah 0,10 atau nilai VIF di atas 5 maka dapat dipastikan telah terjadi multikolinieritas. Hasil uji multikolinieritas dilihat pada tabel 5.

Tabel 5. Hasil penghitungan uji multikolinieritas

No	Variabel	VIF	Keterangan
1	Hari Senin	1,000	Tidak ada multikolinieritas
2	Hari Selasa	1,000	Tidak ada multikolinieritas
3	Hari Rabu	1,000	Tidak ada multikolinieritas
4	Hari Kamis	1,000	Tidak ada multikolinieritas
5	Hari Jumat	1,000	Tidak ada multikolinieritas

Sumber : Lampiran 6

Berdasarkan tabel 5 dapat diketahui hari senin, selasa, rabu, kamis dan jumat nilai VIF kurang dari 5, sehingga dapat diartikan tidak ada multikolinieritas dalam model yang diteliti. Tidak ada multikolinieritas dari variabel yang diteliti menunjukkan bahwa variabel bebas yang digunakan dalam penelitian ini tidak saling berhubungan dengan erat, sehingga variabel yang digunakan benar-benar bersifat independen atau tidak saling tergantung dengan variabel bebas yang lainnya.

#### b. Uji Heteroskedastisitas

Pada penelitian ini pengujian heteroskedastisitas dilakukan dengan menggunakan metode *Rank Spearman*. Hasil uji heteroskedastisitas dapat dilihat pada tabel 6.

Tabel 6. Hasil penghitungan uji heteroskedastisitas

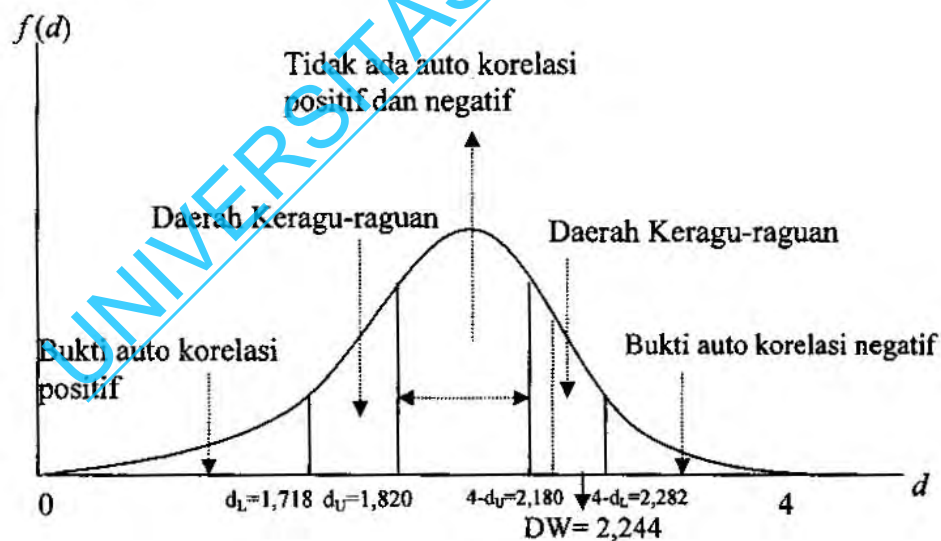
No	Variabel	P 2-tailed	Keterangan
1	Hari Senin	0,355	Tidak ada heteroskedastisitas
2	Hari Selasa	0,188	Tidak ada heteroskedastisitas
3	Hari Rabu	0,070	Tidak ada heteroskedastisitas
4	Hari Jumat	0,296	Tidak ada heteroskedastisitas

Sumber : Lampiran 6

Berdasarkan tabel 6 dapat diketahui bahwa nilai p-value lebih besar dari 0,05. Dengan demikian dapat diartikan model penelitian yang dibuat tidak mengandung heteroskedastisitas.

c. Uji Autokorelasi

Pengujian autokorelasi dilakukan dengan menggunakan koefisien *Durbin Watson* (DW). Hasil perhitungan pada lampiran 6 diperoleh nilai Koefisien *Durbin Watson* sebesar 2,244.



Gambar 2. Kurva uji statistik Durbin-Watson

Nilai *Durbin Watson* tersebut dibandingkan nilai *Durbin Watson* Tabel untuk  $n = 1.710$  dan  $k = 5$  dengan  $(\alpha) 0,05$  atau 5 %, maka nilai  $d_U = 1,820$  dan  $d_L = 1,718$ .

Nilai uji Durbin Watson	= 2,244
Nilai dL	= 1,718
Nilai dU	= 1,820
4 - dU = 4 - 1,820	= 2,180
4 - dL = 4 - 1,718	= 2,282

Berdasarkan hasil uji autokorelasi dapat diketahui nilai Durbin Watson sebesar 2,244. Nilai tersebut berada diantara 4-dU dan 4-dL atau berada di daerah keragu-raguan. Artinya tidak ada kesimpulan autokorelasi positif maupun autokorelasi negatif pada data yang diteliti.

#### 4. Pengujian Hipotesis

##### 4.1. Hipotesis Pertama (H<sub>1</sub>)

*Monday effect* atau efek awal pekan terjadi pada hari Senin. *Monday effect* digunakan untuk menguji hipotesis pertama. Hipotesis pertama menyatakan terjadi *Monday effect* pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia yang mengakibatkan *return* saham terendah pada awal pekan. Penghitungan rata-rata *return* untuk menguji *monday effect* dapat dilihat pada tabel 2. Hasil perhitungan tersebut dicantumkan pada tabel 7.

Tabel 7. Hasil perhitungan *Monday effect*

No	Hari	Rata-rata
1	Senin ( <i>Monday effect</i> )	-0,0038
2	Selasa	0,0014
3	Rabu	0,0444
4	Kamis	0,0041
5	Jumat ( <i>Weekend effect</i> )	-0,0035

Sumber : tabel 3

Berdasarkan tabel 7 dapat diketahui rata-rata *return* pada Hari Senin sebesar -0,0038. Hal ini menunjukkan *return* saham pada hari senin cenderung negatif atau terjadi penurunan harga saham pada hari senin, yaitu dengan rata-rata -0,0038. Adanya *return* rendah pada awal pekan menunjukkan adanya *Monday Effect*, yaitu *return* pada awal pekan yaitu

pada hari Senin cenderung negatif. Dengan demikian hipotesis pertama yang menyatakan terjadi *Monday effect* pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia yang mengakibatkan *return* saham terendah pada awal pekan **diterima**. Hal ini menunjukkan adanya kecenderungan penurunan harga saham pada awal pekan atau hari Senin, sehingga mengakibatkan *return* negatif.

#### 4.2. Hipotesis Kedua (H<sub>2</sub>)

Hipotesis kedua menyatakan terjadi *weekend effect* pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia yang mengakibatkan *return* saham tertinggi pada akhir pekan. Berdasarkan tabel 7 dapat diketahui pada hari Selasa, Rabu, dan Kamis rata-rata *return* positif, yaitu pada hari Selasa sebesar 0,0014, Hari Rabu sebesar 0,0444, dan Hari Kamis sebesar 0,0041. Rata-rata *return* tersebut cenderung mengalami peningkatan. Hal ini menunjukkan pada Hari Selasa, Rabu dan Kamis harga saham cenderung mengalami peningkatan, sehingga mengakibatkan rata-rata *return* bernilai positif. Pada hari Jumat diketahui nilai rata-rata *return* negatif, yaitu sebesar -0,0035. Adanya *return* negatif pada hari Jumat atau pada akhir pekan tersebut menunjukkan tidak adanya pengaruh *weekend effect* yaitu harga saham pada akhir pekan cenderung mengalami penurunan, yaitu dengan rata-rata penurunan sebesar 0,35 persen. Dengan demikian hipotesis kedua yang menyatakan menyatakan terjadi *weekend effect* pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia yang mengakibatkan *return* saham tertinggi pada akhir pekan **ditolak**.

Ditolaknya hipotesis kedua ini menunjukkan bahwa pada akhir pekan atau hari Jumat pada bulan Agustus sampai dengan September tahun 2011 harga saham pada hari Jumat cenderung turun, sehingga *return* bernilai negatif. Penurunan harga saham pada hari Jumat disebabkan oleh adanya transaksi pada Hari Rabu dan Kamis, sehingga pada hari Rabu dan Kamis tersebut harga saham mengalami peningkatan yang mengakibatkan adanya *return* positif pada hari Rabu dan Kamis

tersebut. Hal ini mengakibatkan investor pada hari Jumat sudah tidak lagi tertarik untuk melakukan transaksi sehingga pada hari Jumat harga saham cenderung mengalami penurunan.

#### 4.3. Hipotesis Ketiga (H<sub>3</sub>)

##### a. Analisis regresi

Analisis regresi dilakukan untuk mengetahui pengaruh hari kerja terhadap *return* saham di Bursa Efek Indonesia. Analisis regresi dilakukan dengan Software SPSS for Windows Versi 16. Hasil analisis regresi dapat dilihat pada lampiran 7, sedangkan ringkasan hasil analisis dapat dilihat pada tabel 8.

Tabel 8. Frekuensi Hari Kerja di Bursa Efek Indonesia dari tanggal 2 Agustus sampai dengan 30 September 2011

No	Hari	Standardized Koefisien Regresi	Nilai t hitung	Nilai t tabel
1	Senin	-0,004	-0,204	1,6457
2	Selasa	0,001	0,081	1,6457
3	Rabu	0,044	2,398	1,6457
4	Kamis	0,004	0,234	1,6457
5	Jumat	-0,003	-0,201	1,6457

Berdasarkan lampiran 6 dan tabel 10 dapat dibuat persamaan regresi tanpa konstanta sebagai berikut:

$$R_t = -0,004M + 0,001T + 0,044W + 0,004Th - 0,003F + e$$

Berdasarkan persamaan regresi di atas dapat diketahui koefisien regresi variabel hari Senin sebesar -0,004. Koefisien regresi yang negatif tersebut menunjukkan bahwa pada Hari Senin harga saham yang tergabung dalam LQ 45 cenderung mengalami penurunan, dengan rata-rata penurunan sebesar 0,4 persen. Pada Hari Selasa koefisien regresi sebesar 0,001. Koefisien regresi yang positif tersebut menunjukkan bahwa pada Hari Selasa harga saham yang tergabung dalam LQ 45 cenderung mengalami peningkatan, dengan rata-rata peningkatan sebesar 1 persen.

Koefisien regresi variabel Hari Rabu sebesar 0,044. Nilai koefisien regresi yang positif ini menunjukkan bahwa pada Hari Rabu harga saham yang tergabung dalam LQ 45 cenderung mengalami peningkatan dengan rata-rata peningkatan sebesar 4,4 persen. Koefisien regresi variabel Hari Kamis sebesar 0,004. Nilai koefisien regresi yang positif ini menunjukkan bahwa pada Hari Kamis harga saham yang tergabung dalam LQ 45 cenderung mengalami peningkatan dengan rata-rata peningkatan sebesar 0,4 persen. Pada Hari Jumat juga memiliki koefisien regresi yang negatif, yaitu sebesar -0,003 artinya pada Hari Jumat harga saham yang tergabung dalam LQ 45 cenderung mengalami penurunan dengan rata-rata penurunan sebesar 0,3 persen.

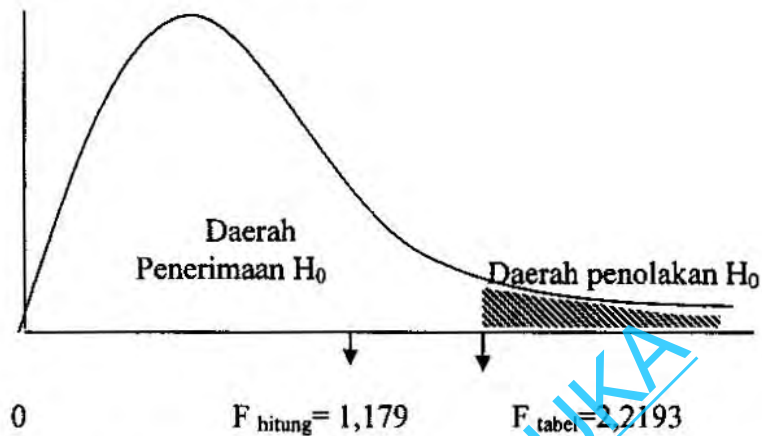
Nilai koefisien determinasi sebesar 0,003, artinya *return* saham di Bursa Efek Indonesia dipengaruhi oleh Hari Kerja (Senin, Selasa, Rabu, Kamis dan Jumat) sebesar 0,3 persen. Sisanya sebesar 0,997 dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak diteliti. Hal ini menunjukkan pengaruh hari kerja selama satu pekan di Bursa Efek Indonesia adalah kecil yaitu sebesar 0,3 persen, karena masih banyak variabel lain yang dapat mempengaruhi *return* saham di Bursa Efek Indonesia.

b. Uji F

Uji F digunakan untuk mengetahui signifikansi pengaruh hari kerja di Bursa Efek Indonesia terhadap *return* saham secara bersama-sama. Berdasarkan lampiran 7 dapat diketahui nilai F hitung sebesar 1,179. Nilai F tabel pada derajat kebebasan ( $df_1=5$  dan  $df_2=1.705$ ) sebesar 2,2193. Jadi F hitung ( $1,179 < F$  tabel ( $2,2193$ )), sehingga F hitung berada di daerah penerimaan  $H_0$ , artinya tidak terdapat pengaruh yang signifikan secara bersama-sama hari kerja di Bursa Efek Indonesia terhadap *return* saham. Dengan demikian hipotesis penelitian yang menyatakan terdapat pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia dapat ditolak.



Kurva daerah penerimaan dan penolakan  $H_0$  untuk pengujian hipotesis 3 dapat dilihat pada gambar 3.



Gambar 3. Daerah penerimaan dan penolakan  $H_0$  uji F

c. Uji t

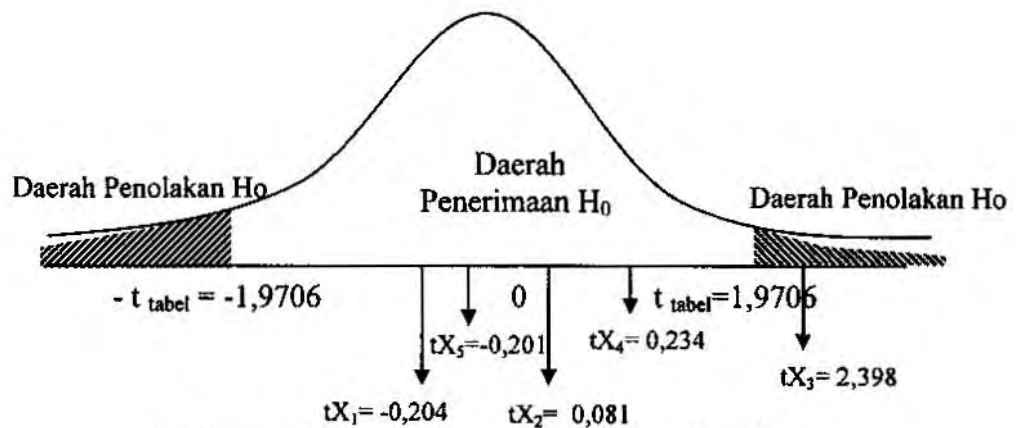
Uji t digunakan untuk mengetahui pengaruh hari kerja secara parsial terhadap *return*. Nilai t hitung variabel Hari Senin sebesar -0,204. Dengan menggunakan tingkat keyakinan 95 % ( $\alpha=0,05$ ) dan derajat kebebasan  $n-k=1710-5=1705$  diperoleh t tabel sebesar 1,6457. Jadi nilai t hitung variabel Hari Senin lebih besar dari nilai -t tabel ( $-0,204 > -1,6457$ ) ( $\text{sig}=0,839$ ), sehingga t hitung variabel Hari Senin berada di daerah penerimaan  $H_0$ .  $H_0$  diterima artinya secara parsial variabel Hari Senin tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham.

Nilai t hitung variabel Hari Selasa sebesar 0,081. Dengan menggunakan tingkat keyakinan 95 % ( $\alpha=0,05$ ) dan derajat kebebasan  $n-k=1710-5=1705$  diperoleh t tabel sebesar 1,6457. Jadi nilai t hitung variabel Hari Selasa lebih kecil dari nilai t tabel ( $0,081 < 1,6457$ ) ( $\text{sig}=0,936$ ), sehingga t hitung variabel Hari Selasa berada di daerah penerimaan  $H_0$ .  $H_0$  diterima artinya secara parsial variabel Hari Selasa tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham.

Nilai t hitung variabel Hari Rabu sebesar 2,398. Dengan menggunakan tingkat keyakinan 95 % ( $\alpha=0,05$ ) dan derajat kebebasan  $n-k= 1710-5 = 1705$  diperoleh t tabel sebesar 1,6457. Jadi nilai t hitung variabel Hari Rabu lebih besar dari nilai t tabel ( $2,398 > 1,6457$ )(sig=0,017), sehingga t hitung variabel Hari Rabu berada di daerah penolakan  $H_0$ .  $H_0$  ditolak artinya secara parsial variabel Hari Rabu mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham.

Nilai t hitung variabel Hari Kamis sebesar 0,234. Dengan menggunakan tingkat keyakinan 95 % ( $\alpha=0,05$ ) dan derajat kebebasan  $n-k= 1710-5 = 1705$  diperoleh t tabel sebesar 1,6457. Jadi nilai t hitung variabel Hari Kamis lebih kecil dari nilai t tabel ( $0,234 > 1,6457$ )(sig=0,815), sehingga t hitung variabel Hari Kamis berada di daerah penerimaan  $H_0$ .  $H_0$  diterima artinya secara parsial variabel Hari Kamis tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham.

Nilai t hitung variabel Hari Jumat sebesar -0,201. Dengan menggunakan tingkat keyakinan 95 % ( $\alpha=0,05$ ) dan derajat kebebasan  $n-k= 1710-5 = 1705$  diperoleh t tabel sebesar 1,6457. Jadi nilai t hitung variabel Hari Jumat lebih besar dari nilai -t tabel ( $-0,201 < -1,6457$ )(sig=0,841), sehingga t hitung variabel Hari Jumat berada di daerah penerimaan  $H_0$ .  $H_0$  diterima artinya secara parsial variabel Hari Jumat tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham. Adapun gambar penolakan dan penerimaan  $H_0$  tersebut dapat dilihat pada gambar 4.



Gambar 4. Daerah penerimaan dan penolakan  $H_0$  uji t

Analisis regresi digunakan untuk menguji hipotesis ketiga. Hipotesis ketiga menyatakan terdapat pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia. Pengujian dilakukan dengan analisis regresi dengan uji F. Uji F digunakan untuk mengetahui signifikansi pengaruh hari kerja di Bursa Efek Indonesia terhadap *return* saham secara bersama-sama. Berdasarkan lampiran 7 dapat diketahui nilai F hitung sebesar 1,179. Nilai F tabel pada derajat kebebasan ( $df_1=5$  dan  $df_2=1.705$ ) sebesar 2,2193. Jadi F hitung ( $1,179 < F$  tabel ( $2,2193$ )), sehingga F hitung berada di daerah penerimaan  $H_0$ , artinya tidak terdapat pengaruh yang signifikan secara bersama-sama hari kerja di Bursa Efek Indonesia terhadap *return* saham. Dengan demikian hipotesis penelitian yang menyatakan terdapat pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia **ditolak**.

## B. Pembahasan

Berdasarkan hasil analisis data dapat diketahui pada hari Senin harga saham cenderung mengalami penurunan. Penurunan harga saham ini berakibat pada nilai *return* negatif, yaitu dengan rata-rata sebesar -0,0038. Pada akhir pekan harga saham juga cenderung mengalami penurunan, yaitu dengan rata-rata penurunan sebesar 0,35 persen.

Berdasarkan hasil penelitian ini juga dapat diketahui hari perdagangan yang berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia adalah hari Rabu. Berdasarkan hasil analisis regresi dan uji F dapat disimpulkan tidak terdapat pengaruh hari perdagangan secara bersama-sama terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia. Hasil penelitian ini tidak sejalan dengan penelitian yang dilakukan oleh Robiyanto (2000) yaitu hari Rabu berpengaruh negatif terhadap saham LQ 45. Hasil penelitian ini juga berbeda dengan penelitian yang dilakukan oleh Dwi Cahyadingdyah (2005), yaitu adanya pengaruh hari perdagangan terhadap *return* pada hari Kamis dan Jumat. Demikian juga dengan penelitian Joko Sangaji (2005) yaitu pada hari Selasa dan Kamis berpengaruh signifikan terhadap *return*.

Berdasarkan hasil analisis uji t satu sampel dapat disimpulkan tidak terdapat perbedaan yang signifikan antara *return* saham harian pada hari-hari perdagangan dalam satu pekan di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini tidak sejalan dengan penelitian Robiyanto (2000) yang menunjukkan terdapat perbedaan *return* saham harian pada hari-hari perdagangan dalam satu pekan di Bursa Efek Indonesia pada saham LQ 45.



## V. KESIMPULAN DAN IMPLIKASI

### A. Kesimpulan

Berdasarkan analisis di atas, penelitian dapat diambil kesimpulan sebagai berikut:

1. Hasil analisis diskriptif diperoleh rata-rata *return* saham pada hari Senin bernilai negatif yaitu sebesar -0,0038, artinya harga saham pada hari Senin mengalami penurunan, sehingga dapat disimpulkan terdapat pengaruh *Monday Effect*, yang mengakibatkan penurunan harga saham pada hari Senin. Dengan demikian hipotesis pertama yang menyatakan terjadi *monday effect* pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia yang mengakibatkan *return* saham negatif pada awal pekan diterima.
2. Rata-rata *return* saham pada hari Jumat bernilai negatif yaitu sebesar -0,0035, artinya harga saham pada hari Jumat mengalami penurunan. *Weekend effect* terjadi jika rata-rata *return* pada hari Jumat positif. Dalam penelitian ini *return* saham pada hari Jumat bernilai negatif, hal ini menunjukkan menunjukkan tidak terdapat pengaruh *weekend effect*. Dengan demikian hipotesis kedua yang menyatakan terjadi *weekend effect* pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia yang mengakibatkan *return* saham positif pada akhir pekan ditolak.
3. Dalam analisis regresi dan uji t bahwa hari perdagangan yang berpengaruh signifikan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia adalah hari Rabu. Kemudian analisis regresi dan uji t tidak terdapat pengaruh hari perdagangan secara bersama-sama terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia. Dengan demikian hipotesis ketiga yang menyatakan terdapat pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian saham di Bursa Efek Indonesia ditolak.

### B. Implikasi

Berdasarkan kesimpulan di atas, implikasi yang dapat dijadikan perhatian kepada para investor adalah:

1. Investor sebaiknya tidak menjual saham pada awal pekan yaitu pada hari senin karena *return* saham pada hari Senin cenderung mengalami penurunan.

2. Investor tidak perlu menunggu sampai akhir pekan (hari Jumat) untuk melakukan aksi jual saham, karena pada hari Rabu adalah saat yang baik untuk menjual saham pada saat itu *return* saham mengalami peningkatan yang tinggi.
3. Investor tidak bisa memperlakukan sama hari-hari dalam satu pekan dalam investasi setiap hari di Pasar Modal Indonesia. Bagi investor yang ada di Bursa Efek Indonesia hendaknya memperhatikan hari perdagangan secara lebih cermat, karena hari perdagangan dari hasil riset diketahui dapat mendatangkan keuntungan investasi di pasar modal. Investor perlu menghindari transaksi pada hari senin dan jumat karena hari tersebut berpengaruh negatif terhadap *return* saham. Pada hari Selasa, Rabu dan Kamis investor memutuskan untuk menjual saham, karena pada hari tersebut nilai *return*nya sangat tinggi. Oleh karena itu investor perlu mengamati hari perdagangan saham yang memberikan *return* positif dan tertinggi. Hari yang memiliki rata-rata *return* positif adalah Hari Selasa, Rabu dan Kamis. Berdasarkan hasil analisis regresi diperoleh Rabu berpengaruh positif terhadap *return*, sehingga investor dapat memilih hari Rabu untuk bertransaksi jual beli saham.

UNIVERSITAS TERBUKA





## DAFTAR PUSTAKA

- Anonim. 2010. **Pasar Modal**. <http://www.idx.co.id>. Diakses tanggal 8 November tahun 2010.
- Cahyaningdyah, Dwi. 2005. **Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Pengujian Week-Four Effect Dan Rogalski Effect di Bursa Efek Indonesia**. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*. Vol 20 No2 2005.
- Eduardus dan Algifari. 1999. **Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham di Bursa Efek Indonesia**. Makalah Seminar Universitas Diponegoro. Semarang.
- Fabozzi. 1999. **Manajemen Investasi**. Penerbit Salemba Empat. Jakarta.
- Gujarati, 1997. **Dasar Dasar Ekonometrika**. Penerbit Erlangga Jakarta.
- Jogiyanto. 1998. **Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Pertama**. BPFE. Yogyakarta.
- Jogiyanto. 2005. **Pasar Efisien Secara Keputusan**. Gramedia Pustaka Utama. Jakarta.
- Joko Sangaji. 2005. **Efek Hari Dalam Seminggu Pada Imbal Hasil Saham PT Aneka Tambang Tbk**. *Jurnal Ekonomi Perusahaan* Vol. 12 No. 1 Maret 2005.
- Kamalh, Ravinda R. Rinjai Chakornpicat dan Arjun Chatrath. 1998. **Return Distributions and The Day of the Week Effect in Stock Exchange of Thailand**. *Journal of Economic and Finance*. Vol. 22 No. 2 – 3.
- Muslich, Mohammad. 1997. **Manajemen Keuangan Modern**. Penerbit Bumi Aksara. Jakarta.
- Robiyanto. 2000. **Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap Return Harian Saham di Bursa Efek Jakarta**. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia* Vol. 20. No.2.2005 175-186.
- Santoso. 2001. **SPSS. Versi 10**. Elexmedia Komputindo. Jakarta.
- Sartono, Agus. 1997. **Manajemen Keuangan, Edisi Ketiga**. BPFE. Yogyakarta.
- Supranto, J. 2001. **Statistik Teori dan Aplikasi**. Jilid 2. Erlangga. Jakarta.
- Sunariyah. 2000. **Pengantar Pengetahuan Pasar Modal, Edisi Kedua**. UPP AMP YKPN. Yogyakarta.



## REKOMENDASI HASIL PENELITIAN

1. Judul Penelitian : **ANALISIS PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP *RETURN* SAHAM PERUSAHAAN UNGGULAN DI BURSA EFEK INDONESIA**

2. **Rekomendasi Pemanfaatan hasil Penelitian Bahan Ajar adalah :**

Penelitian kelembagaan ini memberikan informasi kepada para investor, dimana investor sebaiknya tidak menjual saham pada awal pekan yaitu pada hari Senin karena *return* saham pada hari Senin cenderung mengalami penurunan.

Kemudian Investor juga tidak perlu menunggu sampai akhir pekan (hari Jum'at) untuk melakukan aksi jual saham, karena pada hari Rabu adalah saat yang baik untuk menjual saham pada saat itu *return* saham mengalami peningkatan yang tinggi. Juga investor tidak bisa memperlakukan sama hari-hari dalam satu pekan dalam investasi setiap hari di Pasar Modal Indonesia. Bagi investor yang ada di Bursa Efek Indonesia hendaknya memperhatikan hari perdagangan secara lebih cermat, karena hari perdagangan dari hasil riset diketahui dapat mendatangkan keuntungan investasi di pasar modal. Investor perlu menghindari transaksi pada hari Senin dan Jum'at karena hari tersebut berpengaruh negatif terhadap *return* saham. Pada hari Selasa, Rabu dan Kamis investor memutuskan untuk menjual saham, karena pada hari tersebut nilai *return*nya sangat tinggi. Oleh karena itu investor perlu mengamati hari perdagangan saham yang memberikan *return* positif dan tertinggi. Hari yang memiliki rata-rata *return* positif adalah Hari Selasa, Rabu dan Kamis. Berdasarkan hasil analisis regresi diperoleh Rabu berpengaruh positif terhadap *return*, sehingga investor dapat memilih hari Rabu untuk bertransaksi jual beli saham.

Hasil penelitian ini dapat dijadikan materi studi kasus matakuliah Manajemen Keuangan untuk Program Magister Manajemen dan pengayaan materi modul Matakuliah Manajemen Keuangan pada Program Studi/Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Terbuka.

Lampiran 1. Data Perusahaan

No	Kode	Nama Perusahaan
1	AALI	PT. Astra Agro Lestari Tbk
2	ADRO	PT. Adaro Energy Tbk
3	ANTM	PT. Aneka Tambang Tbk
4	ASII	PT. Astra International Tbk
5	ASRI	PT. Alam Sutera Realty Tbk
6	BBCA	PT. Bank Central Asia Tbk
7	BBKP	PT. Bank Bukopin Tbk
8	BBNI	PT. Bank Negara Indonesia Tbk
9	BBRI	PT. Bank Rakyat Indonesia Tbk
10	BBTN	PT. Bank Tabungan Negara Tbk
11	BDMN	PT. Bank Danamon Indonesia Tbk
12	BJBR	PT. BPD Jawa Barat Tbk
13	BMRI	PT. Bank Mandiri Tbk
14	BNBR	PT. Bakrie & Brothers Tbk
15	BRAU	PT. Berau Coal Energy Tbk
16	BSDE	PT. Bumi Serpong Damai Tbk
17	BTEL	PT. Bakrie Telecom Tbk
18	BUMI	PT. Bumi Resources Tbk
19	CPIN	PT. Charoen Pokphand Indonesia Tbk
20	DOID	PT. Delta Dunia Makmur Tbk
21	ELSA	PT. Elnusa Tbk
22	ELTY	PT. Bakrieland Development Tbk
23	ENRG	PT. Energi Mega Persada Tbk
24	GGRM	PT. Gudang Garam Tbk
25	GJTL	PT. Gajah Tungga Tbk
26	INCO	PT. International Nickel Indonesia Tbk
27	INDF	PT. Indofood Sukses Makmur Tbk
28	INDY	PT. Indika Energy Tbk
29	INTP	PT. Indocement Tunggul Prakarsa Tbk
30	ISAT	PT. Indosat Tbk
31	ITMG	PT. Indotambang Raya Megah Tbk
32	JSMR	PT. Jasamarga Tbk
33	KLBF	PT. Kalbe Farma Tbk
34	LPKR	PT. Lippo Karawaci Tbk
35	LSIP	PT. PP London Sumatra Indonesia Tbk
36	MEDC	PT. Medco Energi Internasional Tbk
37	PGAS	PT. Perusahaan Gas Negara Tbk
38	PTBA	PT. Tambang Batubara Bukit Asam Tbk
39	SMCB	PT. Holcim Indonesia Tbk
40	SMGR	PT. Semen Gresik Tbk
41	TINS	PT. Timah Tbk
42	TLKM	PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk
43	UNSP	PT. Bakrie Sumatera Plantations Tbk
44	UNTR	PT. United Tractors Tbk
45	UNVR	PT. Unilever Indonesia Tbk



Lanjutan lampiran 2

Tanggal	GGRM	GJTL	INCO	INDF	INDY	INTP	ISAT	ITMG	JSMR	KLBF	LPKR	LSIP	MEDC	PGAS	PTBA	SMCB	SMGR	TINS	TLKM	UNSP	UNTR	UNVR
01/08/2011	53.000	3.125	4.275	6.400	3.650	15.500	5.600	50.750	3.975	3.525	850	2.375	2.500	4.000	21.400	2.100	9.400	2.475	7.500	440	27.550	15.900
02/08/2011	53.250	3.025	4.200	6.300	3.675	15.250	5.800	50.400	4.000	3.475	850	2.400	2.525	4.000	21.400	2.100	9.450	2.425	7.600	450	26.500	16.000
03/08/2011	52.000	3.150	4.125	6.450	3.625	14.750	5.800	49.000	3.950	3.400	830	2.400	2.500	3.825	21.250	2.100	9.250	2.375	7.550	445	26.100	16.100
04/08/2011	52.700	3.200	4.075	6.500	3.575	14.600	5.800	48.300	3.900	3.325	820	2.400	2.475	3.600	20.850	2.050	9.150	2.350	7.800	435	25.300	17.000
05/08/2011	51.150	2.975	3.825	6.400	3.325	13.850	5.650	44.750	3.825	3.200	770	2.300	2.350	3.175	19.700	1.960	8.900	2.100	7.550	395	24.300	16.250
08/08/2011	50.000	2.875	3.700	6.200	3.200	14.300	5.400	44.250	3.875	3.175	730	2.275	2.375	3.275	19.350	1.950	9.150	2.075	7.500	385	23.950	16.000
09/08/2011	50.000	2.750	3.525	6.100	3.125	14.400	5.200	42.800	3.725	2.975	720	2.275	2.325	3.200	17.850	1.920	8.700	1.980	7.200	365	23.200	15.000
10/08/2011	50.950	2.875	3.625	6.350	3.250	14.800	5.300	44.850	3.825	3.325	760	2.275	2.400	3.325	18.700	1.960	8.850	2.075	7.100	375	24.400	15.800
11/08/2011	52.950	2.950	3.700	6.500	3.175	14.450	5.550	43.500	3.800	3.450	780	2.300	2.500	3.375	18.800	1.930	8.800	2.150	7.350	370	24.400	16.400
12/08/2011	54.950	2.975	3.800	6.450	3.225	14.500	5.450	44.500	3.900	3.425	790	2.325	2.575	3.375	18.850	1.980	8.850	2.225	7.300	380	24.100	16.400
15/08/2011	54.550	3.025	3.850	6.450	3.225	15.300	5.750	46.500	3.925	3.425	790	2.375	2.600	3.375	19.100	2.050	8.900	2.325	7.250	390	24.650	16.750
16/08/2011	54.200	3.000	3.875	6.400	3.225	15.000	5.450	45.800	4.050	3.350	790	2.375	2.525	3.325	19.100	2.025	8.900	2.275	7.200	385	24.550	16.800
18/08/2011	56.000	3.025	3.925	6.450	3.250	15.400	5.800	45.650	4.050	3.525	800	2.375	2.525	3.425	19.700	2.025	9.100	2.325	7.450	405	25.100	17.350
19/08/2011	53.000	2.900	3.700	6.100	3.075	14.600	5.550	43.400	3.975	3.325	730	2.300	2.375	3.300	18.800	1.930	8.800	2.175	7.400	385	23.500	16.550
22/08/2011	53.950	2.900	3.750	6.450	3.100	15.000	5.400	43.000	4.025	3.400	730	2.400	2.400	3.225	19.350	1.950	9.050	2.175	7.300	380	23.400	16.650
23/08/2011	53.950	2.950	3.725	6.750	3.200	15.050	5.400	43.300	4.050	3.450	730	2.425	2.450	3.225	19.600	1.960	9.250	2.225	7.300	385	23.950	16.800
24/08/2011	54.150	2.950	3.575	6.450	3.150	14.800	5.400	43.300	4.025	3.400	740	2.400	2.425	3.100	19.250	1.950	9.250	2.175	7.250	375	23.950	16.450
25/08/2011	54.150	2.950	3.500	6.200	3.175	14.750	5.350	43.250	4.025	3.400	740	2.400	2.425	3.000	19.300	1.920	9.100	2.250	7.200	380	24.000	16.150
26/08/2011	55.000	2.900	3.650	6.100	3.175	15.200	5.250	43.150	4.000	3.475	740	2.400	2.375	2.950	19.050	1.940	9.100	2.225	7.250	370	23.600	16.900
05/09/2011	55.600	2.950	3.700	5.950	3.175	15.500	5.500	42.550	4.100	3.450	730	2.350	2.325	2.775	19.200	1.920	9.350	2.200	7.550	375	24.400	16.750
06/09/2011	56.600	2.950	3.725	5.950	3.175	15.600	5.800	44.250	4.225	3.525	740	2.325	2.400	2.750	19.250	1.950	9.200	2.225	7.650	380	24.300	17.000
07/09/2011	58.700	3.100	3.975	6.000	3.400	15.900	6.000	46.650	4.200	3.600	740	2.325	2.500	2.925	19.630	2.050	9.300	2.350	7.900	395	24.650	17.400
08/09/2011	59.350	3.150	4.000	5.950	3.350	15.600	5.800	46.000	4.200	3.600	740	2.325	2.500	2.925	19.800	2.100	9.250	2.325	7.650	390	24.900	17.550
09/09/2011	59.800	3.150	3.925	5.900	3.350	15.450	5.700	45.800	4.175	3.600	750	2.300	2.400	2.900	19.700	2.050	9.150	2.275	7.600	385	25.300	17.550
12/09/2011	57.250	3.000	3.800	5.700	3.225	15.000	5.500	44.400	3.950	3.625	730	2.300	2.500	2.800	19.250	2.000	8.900	2.175	7.400	370	24.300	17.050
13/09/2011	58.000	2.975	3.750	5.700	3.050	14.800	5.600	44.700	4.000	3.625	730	2.300	2.500	2.900	18.800	1.990	8.900	2.175	7.350	375	23.600	17.050
14/09/2011	58.000	2.875	3.725	5.550	2.950	14.150	5.450	43.950	4.000	3.575	720	2.300	2.500	2.725	18.400	1.980	8.750	2.125	7.350	370	23.100	17.100
15/09/2011	55.900	2.800	3.600	5.450	2.875	14.100	5.650	43.650	4.000	3.450	700	2.200	2.525	2.750	17.800	1.980	8.500	2.125	7.500	370	22.900	16.700
16/09/2011	56.150	2.875	3.750	5.650	3.000	14.050	5.800	44.550	4.000	3.550	700	2.225	2.525	2.675	17.950	1.990	8.700	2.125	7.350	370	23.500	16.850
19/09/2011	55.500	2.750	3.650	5.400	2.900	13.350	5.750	44.500	3.925	3.475	700	2.200	2.500	2.575	17.600	1.930	8.500	2.075	7.450	355	23.100	16.050
20/09/2011	54.500	2.750	3.625	5.250	2.900	13.250	5.650	44.800	3.950	3.450	700	2.150	2.500	2.600	17.300	1.920	8.400	2.100	7.450	360	23.000	16.050
21/09/2011	53.100	2.725	3.525	5.000	2.850	13.200	5.600	4.400	3.950	3.400	700	2.150	2.450	2.525	17.100	1.880	8.250	2.100	7.550	355	22.150	15.800
22/09/2011	50.300	2.425	3.050	4.350	2.575	11.200	5.400	38.750	3.575	2.825	660	1.920	2.150	2.200	15.600	1.760	7.700	1.870	6.900	310	20.050	15.000
23/09/2011	50.000	2.350	3.050	4.600	2.475	12.500	5.550	40.650	3.600	2.900	660	1.920	2.175	2.350	15.750	1.770	8.150	1.870	7.200	305	19.750	15.350
26/09/2011	49.000	2.200	2.900	4.500	2.300	11.950	5.500	38.800	3.500	3.950	630	1.760	2.050	2.350	14.750	1.780	7.850	1.700	7.200	275	19.700	15.200
27/09/2011	51.600	2.425	3.000	4.700	2.400	12.850	5.350	39.900	3.775	3.100	680	1.910	2.175	2.650	15.450	1.730	8.100	1.810	7.250	300	21.100	15.600
28/09/2011	51.550	2.550	2.975	4.725	2.375	13.350	5.400	40.200	3.950	3.225	680	1.930	2.150	2.775	16.100	1.730	8.350	1.820	7.350	290	21.950	15.600
29/09/2011	50.500	2.575	2.975	4.850	2.300	13.900	5.450	40.300	3.975	3.225	680	2.025	2.125	2.775	16.300	1.740	8.550	1.790	7.450	290	21.950	15.700
30/09/2011	52.500	2.475	3.025	5.050	2.250	14.000	5.250	39.250	3.975	3.250	680	2.050	2.150	2.675	16.800	1.780	8.300	1.770	7.600	285	22.000	16.500

Lampiran 3. Nilai Return Saham

Tanggal	AAJI	ADRO	ANTM	ASII	ASRI	BBCA	BBKP	BBNI	BBRI	BBTN	BDMN	BIBR	BMRI	BNBR	BRAU	BSDE	BTEL	BUMI	CPIN	DOID	ELSA	ELTY	ENRG
01/08/2011	-0,013	-0,009	0,000	-0,006	-0,011	0,023	-0,023	-0,033	0,007	-0,012	0,000	-0,016	-0,019	0,014	0,019	-0,019	0,000	0,032	-0,065	0,021	-0,017	-0,006	-0,019
02/08/2011	-0,013	-0,019	-0,012	-0,008	-0,023	-0,006	0,012	-0,011	-0,007	-0,018	0,000	-0,016	-0,032	-0,014	0,000	-0,029	0,000	-0,008	0,089	-0,010	-0,018	-0,029	-0,019
03/08/2011	0,013	0,000	0,000	-0,004	-0,024	-0,011	-0,024	-0,040	-0,014	-0,006	-0,009	-0,008	0,007	-0,014	-0,018	0,000	-0,042	-0,016	0,056	-0,021	0,000	-0,036	-0,059
04/08/2011	-0,067	-0,087	-0,040	-0,045	-0,072	-0,035	0,060	-0,024	-0,063	-0,060	-0,045	-0,067	-0,045	-0,086	-0,056	-0,059	-0,015	-0,071	-0,079	-0,108	-0,071	-0,080	-0,125
05/08/2011	0,030	-0,021	-0,026	-0,032	0,013	-0,030	0,060	0,000	-0,023	-0,038	-0,019	-0,018	0,000	-0,016	-0,039	-0,042	-0,015	-0,051	-0,048	-0,024	-0,058	0,013	-0,024
08/08/2011	-0,049	-0,065	-0,027	-0,015	-0,038	-0,025	-0,038	-0,031	-0,031	-0,048	-0,048	-0,028	-0,020	-0,048	-0,010	-0,033	-0,061	-0,063	-0,010	-0,049	-0,041	-0,072	-0,083
09/08/2011	0,000	0,126	0,027	0,058	0,080	0,019	0,027	0,038	0,040	0,048	0,020	0,047	0,042	0,033	0,072	0,067	0,000	0,038	0,040	0,039	0,021	0,050	0,043
11/08/2011	0,009	-0,051	0,021	-0,006	0,062	-0,019	0,000	0,009	0,015	0,013	0,010	-0,009	-0,027	0,048	0,000	0,063	0,113	0,000	-0,010	0,063	0,021	0,000	0,020
12/08/2011	-0,002	0,000	0,026	-0,004	0,000	0,013	0,000	0,030	0,008	0,008	0,049	0,009	-0,014	0,000	-0,019	0,010	-0,043	-0,019	0,020	0,000	0,020	-0,007	0,025
15/08/2011	0,023	0,011	0,020	0,042	0,000	0,025	0,000	0,030	0,015	0,013	0,028	0,018	0,014	0,000	0,000	0,010	-0,015	0,019	0,048	0,012	0,000	0,014	0,024
16/08/2011	-0,007	0,000	-0,015	0,000	0,000	0,000	0,000	0,006	0,015	0,13	-0,018	-0,009	-0,007	0,015	0,020	0,019	0,046	0,009	-0,009	0,023	0,000	0,000	-0,048
18/08/2011	0,030	0,021	0,015	0,039	-0,012	0,006	-0,013	0,023	0,022	0,038	0,009	0,000	0,014	0,045	0,058	0,000	0,147	0,009	0,019	0,045	0,000	0,000	0,025
19/08/2011	-0,034	-0,063	-0,030	-0,091	-0,059	-0,024	-0,039	-0,062	-0,066	-0,071	-0,046	-0,054	-0,054	-0,058	-0,018	-0,048	-0,077	-0,018	-0,045	-0,065	-0,080	-0,040	-0,073
22/08/2011	0,000	-0,011	0,010	0,025	0,000	-0,031	0,000	-0,030	-0,008	-0,012	-0,038	0,000	-0,022	0,015	0,000	-0,020	-0,014	-0,037	0,000	0,023	0,043	0,000	0,021
23/08/2011	-0,002	0,011	0,000	-0,007	0,050	0,026	-0,014	0,025	0,016	0,025	0,044	0,000	0,015	0,000	0,000	0,020	0,000	-0,013	0,067	0,000	0,000	-0,007	0,021
24/08/2011	0,000	-0,056	-0,010	0,001	0,000	-0,006	-0,014	-0,012	-0,008	-0,012	-0,010	-0,009	-0,007	-0,030	-0,019	0,040	0,000	0,004	0,018	-0,011	0,000	0,021	-0,020
25/08/2011	0,009	-0,012	-0,026	0,004	0,024	0,013	0,000	0,006	0,016	-0,012	-0,010	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	0,014	-0,019	-0,053	0,000	-0,021	-0,014	-0,015
26/08/2011	-0,011	-0,036	-0,005	-0,019	-0,023	0,000	-0,028	0,000	0,008	-0,019	0,020	0,000	-0,007	0,000	0,000	0,000	0,028	0,000	0,019	-0,011	0,021	0,000	0,000
05/09/2011	0,016	-0,017	0,005	0,025	0,012	0,019	0,014	0,012	0,015	-0,006	0,043	0,010	0,000	-0,016	0,000	-0,019	0,027	0,000	-0,018	-0,023	0,000	-0,007	-0,005
08/09/2011	0,014	0,018	0,000	0,010	0,048	-0,006	0,000	-0,018	-0,014	0,000	-0,027	-0,009	0,000	0,015	-0,019	-0,010	0,000	0,020	0,046	0,000	-0,021	0,000	0,011
07/09/2011	0,016	0,025	0,032	0,040	0,024	0,018	0,029	0,025	0,030	0,039	0,037	0,018	0,044	0,032	0,038	0,010	0,000	0,058	0,044	0,048	0,064	0,035	0,026
09/09/2011	0,005	-0,012	-0,021	-0,010	0,048	-0,006	0,000	-0,018	-0,014	0,000	-0,027	-0,009	0,000	0,015	-0,019	-0,010	-0,013	0,028	-0,026	0,000	0,000	-0,014	-0,015
12/09/2011	-0,034	-0,027	-0,021	-0,013	-0,045	-0,036	-0,043	-0,018	-0,036	-0,019	-0,019	-0,036	-0,042	-0,016	0,000	-0,010	-0,014	-0,045	-0,018	-0,034	0,000	-0,035	-0,036
13/09/2011	0,009	0,000	0,000	0,282	0,000	0,066	0,015	-0,006	-0,030	-0,026	-0,048	0,000	-0,016	-0,016	0,000	0,000	-0,027	0,019	0,009	-0,012	0,000	0,007	-0,005
14/09/2011	0,002	-0,005	-0,022	-0,250	-0,012	-0,043	-0,029	-0,025	-0,039	-0,013	0,020	-0,010	-0,058	-0,016	-0,038	-0,051	0,014	-0,037	-0,045	0,000	0,000	-0,036	-0,011
15/09/2011	0,000	-0,010	-0,022	-0,022	0,024	0,019	-0,030	-0,013	0,024	-0,020	-0,048	0,000	-0,016	0,000	0,000	0,000	-0,014	-0,010	-0,019	-0,012	-0,021	0,000	-0,033
16/09/2011	0,028	0,021	0,022	0,009	0,012	0,000	0,031	0,058	0,024	-0,007	0,000	0,010	0,047	0,016	0,023	0,032	-0,014	0,038	0,058	0,000	0,000	0,000	0,000
19/09/2011	-0,018	-0,020	-0,016	-0,014	-0,023	-0,006	-0,045	-0,049	-0,047	-0,041	-0,015	-0,029	-0,045	-0,045	0,000	-0,031	0,014	-0,019	-0,027	-0,061	-0,021	-0,030	-0,073
20/09/2011	-0,007	-0,010	0,006	0,006	-0,012	0,013	0,000	0,006	0,008	-0,036	-0,005	0,000	-0,008	0,017	-0,073	-0,032	-0,014	0,000	0,028	0,026	-0,022	0,038	0,061
21/09/2011	0,000	-0,010	-0,011	-0,021	0,000	-0,025	-0,032	-0,013	-0,016	-0,037	0,010	-0,020	-0,016	-0,016	0,000	-0,022	-0,014	-0,028	-0,045	0,000	0,000	-0,029	-0,040
22/09/2011	-0,041	-0,100	-0,090	-0,094	-0,108	-0,084	-0,115	-0,148	-0,131	-0,178	-0,066	-0,140	-0,145	-0,100	-0,120	-0,073	-0,014	-0,126	-0,162	-0,114	-0,111	-0,068	-0,113
23/09/2011	-0,010	-0,035	-0,025	0,015	-0,014	0,056	0,000	0,038	0,057	0,066	0,044	0,012	0,057	0,019	0,034	-0,014	-0,029	-0,033	0,000	-0,029	0,025	-0,008	-0,007
26/09/2011	-0,094	-0,079	-0,095	-0,031	-0,014	-0,020	-0,074	0,000	-0,045	-0,027	-0,068	-0,046	-0,018	-0,073	-0,022	-0,075	0,000	-0,080	-0,080	-0,044	-0,044	-0,115	-0,108
27/09/2011	0,032	0,072	0,028	0,062	0,042	0,020	0,100	0,036	0,075	0,064	0,028	0,084	0,082	0,039	0,034	0,061	0,000	0,063	0,198	0,077	0,071	0,093	0,114
28/09/2011	-0,385	0,037	-0,014	0,027	-0,013	0,007	-0,018	0,028	0,026	0,000	-0,011	-0,022	0,042	-0,019	-0,011	0,025	0,000	-0,035	-0,021	0,000	-0,048	-0,025	-0,048
29/09/2011	0,617	0,024	-0,007	0,030	0,000	0,013	0,056	0,014	0,000	0,017	0,011	0,034	0,040	0,000	-0,044	0,037	0,000	-0,059	0,011	0,000	0,000	-0,026	-0,021
30/09/2011	0,000	-0,006	0,042	-0,006	0,041	0,007	-0,018	0,007	-0,008	0,017	0,005	-0,011	-0,023	-0,019	-0,011	0,024	0,000	0,010	0,000	-0,014	-0,010	0,000	-0,036

Lanjutan Lampiran 3

Tanggal	GGRM	GJTL	INCO	INDF	INDY	INTP	ESAT	ITMG	JSMR	KLBF	LPKR	LSIP	MEDC	PGAS	PTBA	SMCB	SMGR	TINS	TLKM	UNSP	UNTR	UNVR	
01/08/2011																							
02/08/2011	0,005	-0,032	-0,018	-0,016	0,007	-0,016	0,036	-0,007	0,006	-0,014	0,000	0,011	0,010	0,000	0,000	0,000	0,005	-0,020	0,013	0,023	-0,038	0,006	
03/08/2011	-0,023	0,041	-0,018	0,024	-0,014	-0,033	0,000	-0,028	-0,013	-0,022	-0,024	0,000	-0,010	-0,044	-0,007	0,000	-0,021	-0,021	-0,007	-0,011	-0,015	0,006	
04/08/2011	0,013	0,016	-0,012	0,008	-0,014	-0,010	0,000	-0,014	-0,013	-0,022	-0,012	0,000	-0,010	-0,059	-0,019	-0,024	-0,011	-0,011	0,033	-0,022	-0,031	0,056	
05/08/2011	-0,029	-0,070	-0,061	-0,015	-0,070	-0,051	-0,026	-0,073	-0,019	-0,038	-0,061	-0,042	-0,051	-0,118	-0,055	-0,044	-0,027	-0,106	-0,032	-0,092	-0,040	-0,044	
08/08/2011	-0,022	-0,034	-0,033	-0,031	-0,038	0,041	-0,041	-0,011	0,013	-0,008	-0,052	-0,011	0,011	0,031	-0,018	-0,005	0,028	-0,012	-0,007	-0,025	-0,014	-0,015	
09/08/2011	0,000	-0,043	-0,047	-0,016	-0,023	-0,007	-0,031	-0,033	-0,039	-0,063	-0,014	0,000	-0,021	-0,023	-0,078	-0,015	-0,049	-0,046	-0,040	-0,052	-0,031	-0,063	
10/08/2011	0,019	0,045	0,028	0,041	0,040	0,028	0,019	0,048	0,027	0,118	0,056	0,000	0,032	0,039	0,048	0,021	0,017	0,048	-0,014	0,027	0,052	0,053	
11/08/2011	0,039	0,026	0,021	0,024	-0,023	-0,024	0,041	0,040	0,007	0,338	0,026	0,011	0,042	0,015	0,005	-0,015	-0,006	0,036	0,035	-0,013	0,000	0,038	
12/08/2011	0,038	0,008	0,027	-0,008	0,016	0,003	-0,018	0,013	0,013	-0,007	0,013	0,011	0,010	0,030	0,000	0,003	0,026	0,006	0,035	-0,007	0,027	-0,012	
15/08/2011	-0,007	0,017	0,013	0,000	0,000	0,055	0,055	0,045	0,006	0,000	0,000	0,022	0,010	0,000	0,013	0,035	0,006	0,045	-0,007	0,026	0,023	0,021	
16/08/2011	-0,006	-0,008	0,006	-0,008	0,000	-0,020	-0,052	-0,011	0,032	-0,022	0,000	0,000	-0,029	-0,015	0,000	-0,012	0,000	-0,022	-0,007	0,013	-0,004	0,003	
18/08/2011	0,033	0,008	0,013	0,008	0,008	0,027	0,064	0,001	0,040	0,052	0,013	0,000	0,000	0,030	0,031	0,000	0,022	0,022	0,035	0,052	0,022	0,033	
19/08/2011	-0,054	-0,041	-0,057	-0,054	-0,054	-0,052	-0,043	-0,049	-0,011	-0,028	-0,088	-0,032	-0,059	-0,036	-0,046	-0,047	-0,033	-0,065	-0,007	-0,049	-0,064	-0,046	
22/08/2011	0,018	0,000	0,014	0,057	0,008	0,027	-0,027	-0,009	0,011	0,067	0,000	0,043	0,011	-0,023	0,029	0,010	0,028	0,000	-0,014	-0,013	-0,004	2,725	
23/08/2011	0,000	0,017	-0,007	0,047	0,032	0,007	0,000	0,007	0,006	0,015	0,000	0,010	0,021	0,000	0,013	0,005	0,022	0,023	0,000	0,013	0,024	-0,727	
24/08/2011	0,001	0,000	-0,040	-0,044	-0,016	-0,017	0,000	0,000	-0,006	-0,011	0,000	-0,031	-0,010	-0,039	-0,018	-0,005	0,000	-0,022	-0,007	-0,026	0,000	-0,021	
25/08/2011	0,003	0,000	-0,021	-0,039	0,008	-0,003	-0,009	-0,694	0,000	0,000	0,014	0,021	0,000	-0,032	0,003	-0,015	-0,016	0,034	-0,007	0,013	0,002	-0,018	
26/08/2011	0,016	-0,017	0,043	-0,016	0,000	0,031	-0,029	2,257	-0,006	0,022	0,000	0,000	-0,021	-0,017	-0,013	0,010	0,000	-0,011	0,007	-0,026	-0,017	0,046	
05/09/2011	0,011	0,017	0,014	-0,025	0,000	0,020	0,048	-0,014	0,025	-0,007	-0,114	-0,021	-0,021	-0,059	0,008	-0,010	0,027	-0,011	0,041	0,014	0,034	-0,009	
06/09/2011	0,018	0,000	0,007	0,000	0,000	0,006	0,055	0,040	0,030	0,022	0,000	-0,011	0,032	-0,009	0,003	0,016	-0,016	0,011	0,013	0,013	-0,004	0,015	
07/09/2011	0,037	0,051	0,067	0,008	0,071	0,019	0,034	0,054	-0,006	0,021	0,044	0,000	0,042	0,064	0,020	0,051	0,011	0,056	0,033	0,039	0,014	0,024	
08/09/2011	0,011	0,016	0,006	-0,008	-0,015	-0,019	-0,033	-0,014	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	-0,009	-0,005	-0,024	-0,011	-0,022	-0,032	-0,013	0,010	0,009	
09/09/2011	0,008	0,000	-0,019	-0,008	0,000	-0,010	-0,017	-0,004	-0,006	0,000	0,014	-0,011	0,000	0,000	0,000	0,024	0,005	-0,011	-0,032	-0,013	0,010	0,000	
12/09/2011	-0,043	-0,048	-0,032	-0,034	-0,037	-0,029	-0,035	-0,031	-0,054	0,007	-0,027	0,000	0,000	-0,034	-0,023	-0,024	-0,027	-0,044	-0,026	0,014	-0,029	0,000	
13/09/2011	0,013	-0,008	-0,013	0,000	-0,054	-0,013	0,018	0,007	0,013	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	-0,023	-0,005	0,000	0,000	-0,007	0,014	-0,039	-0,031	
14/09/2011	0,000	-0,034	-0,007	-0,026	-0,033	-0,044	-0,027	-0,017	0,000	-0,014	-0,014	0,000	0,010	-0,027	-0,021	-0,005	-0,017	-0,023	0,000	-0,013	-0,021	0,003	
15/09/2011	-0,036	-0,026	-0,034	-0,018	-0,025	-0,004	0,037	-0,007	0,000	-0,035	-0,028	-0,043	0,000	0,000	-0,033	0,000	-0,029	0,000	0,020	0,000	-0,009	-0,023	
16/09/2011	0,004	0,027	0,042	0,037	0,043	-0,004	0,027	0,021	0,000	0,029	0,000	0,011	0,000	-0,048	0,008	0,005	0,024	0,000	-0,020	0,000	0,026	0,009	
19/09/2011	-0,012	-0,043	-0,027	-0,044	-0,033	-0,050	-0,009	-0,001	-0,019	-0,021	0,000	-0,011	-0,010	0,031	-0,019	-0,030	-0,023	-0,024	0,014	-0,041	-0,017	-0,047	
20/09/2011	-0,018	0,000	-0,007	-0,028	0,000	-0,007	-0,017	0,007	0,006	-0,007	0,000	-0,023	0,000	0,000	-0,017	-0,005	-0,012	0,012	0,000	0,014	-0,004	0,000	
21/09/2011	-0,026	-0,009	-0,028	-0,048	-0,017	-0,004	-0,009	-0,902	0,000	-0,014	0,000	0,000	-0,020	-0,039	-0,012	-0,018	-0,018	0,000	0,013	-0,014	-0,037	-0,016	
22/09/2011	-0,053	-0,110	-0,135	-0,130	-0,096	-0,152	-0,036	7,807	-0,095	-0,169	-0,057	-0,107	-0,122	-0,129	-0,087	-0,064	-0,067	-0,110	-0,086	-0,127	-0,095	-0,051	
23/09/2011	-0,006	-0,031	0,000	0,057	-0,039	0,116	0,028	0,049	0,007	0,027	0,000	0,005	0,012	0,068	0,010	-0,006	0,058	0,000	0,043	-0,016	-0,015	0,023	
26/09/2011	-0,020	-0,064	-0,049	-0,022	-0,071	-0,044	-0,009	-0,046	-0,028	0,362	-0,045	-0,088	-0,057	0,000	-0,043	-0,040	-0,037	-0,091	0,000	-0,098	-0,003	-0,010	
27/09/2011	0,053	0,102	0,034	0,044	0,043	0,075	-0,027	0,028	0,079	-0,215	0,079	0,085	0,061	0,128	0,047	0,000	0,032	0,065	0,007	0,091	0,071	0,026	
28/09/2011	-0,001	0,052	-0,008	0,005	8,906	0,039	0,009	0,018	0,046	0,040	0,000	0,010	-0,011	0,047	0,042	0,000	0,031	0,006	0,014	-0,033	0,040	0,000	
29/09/2011	-0,020	0,010	0,000	0,026	-0,903	0,041	0,009	-0,007	0,006	0,016	0,000	0,049	-0,012	0,000	0,012	0,006	0,024	-0,016	0,014	0,000	0,000	0,006	
30/09/2011	0,040	-0,039	0,017	0,041	-0,022	0,007	-0,037	-0,024	0,000	-0,008	0,000	0,012	0,012	-0,036	0,031	0,023	-0,029	-0,011	0,020	-0,017	0,002	0,051	



Lampiran 4. Input Analisis

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1	AALI	02/08/2011	-0,01277	0	1	0	0	0
2	AALI	03/08/2011	-0,01293	0	0	1	0	0
3	AALI	04/08/2011	0,01310	0	0	0	1	0
4	AALI	05/08/2011	-0,06681	0	0	0	0	1
5	AALI	08/08/2011	0,03002	1	0	0	0	0
6	AALI	09/08/2011	-0,04933	0	1	0	0	0
7	AALI	10/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
8	AALI	11/08/2011	0,00943	0	0	0	1	0
9	AALI	12/08/2011	-0,00234	0	0	0	0	1
10	AALI	15/08/2011	0,02342	1	0	0	0	0
11	AALI	16/08/2011	-0,00686	0	1	0	0	0
12	AALI	18/08/2011	0,02995	0	0	0	1	0
13	AALI	19/08/2011	-0,03356	0	0	0	0	1
14	AALI	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
15	AALI	23/08/2011	-0,00231	0	1	0	0	0
16	AALI	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
17	AALI	25/08/2011	0,00928	0	0	0	1	0
18	AALI	26/08/2011	-0,01149	0	0	0	0	1
19	AALI	05/09/2011	0,01628	1	0	0	0	0
20	AALI	06/09/2011	0,01373	0	1	0	0	0
21	AALI	07/09/2011	0,01580	0	0	1	0	0
22	AALI	08/09/2011	-0,01333	0	0	0	1	0
23	AALI	09/09/2011	0,00450	0	0	0	0	1
24	AALI	12/09/2011	-0,03363	1	0	0	0	0
25	AALI	13/09/2011	0,00928	0	1	0	0	0
26	AALI	14/09/2011	0,00230	0	0	1	0	0
27	AALI	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
28	AALI	16/09/2011	0,02752	0	0	0	0	1
29	AALI	19/09/2011	-0,01786	1	0	0	0	0
30	AALI	20/09/2011	-0,00682	0	1	0	0	0
31	AALI	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
32	AALI	22/09/2011	-0,04119	0	0	0	1	0
33	AALI	23/09/2011	-0,00955	0	0	0	0	1
34	AALI	26/09/2011	-0,09398	1	0	0	0	0
35	AALI	27/09/2011	0,03191	0	1	0	0	0
36	AALI	28/09/2011	-0,38479	0	0	1	0	0
37	AALI	29/09/2011	0,61709	0	0	0	1	0
38	AALI	30/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
39	ADRO	02/08/2011	-0,00935	0	1	0	0	0
40	ADRO	03/08/2011	-0,01887	0	0	1	0	0
41	ADRO	04/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
42	ADRO	05/08/2011	-0,08654	0	0	0	0	1
43	ADRO	08/08/2011	-0,02105	1	0	0	0	0
44	ADRO	09/08/2011	-0,06452	0	1	0	0	0
45	ADRO	10/08/2011	0,12644	0	0	1	0	0
46	ADRO	11/08/2011	-0,05102	0	0	0	1	0
47	ADRO	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
48	ADRO	15/08/2011	0,01075	1	0	0	0	0
49	ADRO	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
50	ADRO	18/08/2011	0,02128	0	0	0	1	0
51	ADRO	19/08/2011	-0,06250	0	0	0	0	1
52	ADRO	22/08/2011	-0,01111	1	0	0	0	0
53	ADRO	23/08/2011	0,01124	0	1	0	0	0
54	ADRO	24/08/2011	-0,05556	0	0	1	0	0
55	ADRO	25/08/2011	-0,01176	0	0	0	1	0
56	ADRO	26/08/2011	-0,03571	0	0	0	0	1
57	ADRO	05/09/2011	-0,01728	1	0	0	0	0
58	ADRO	06/09/2011	0,01759	0	1	0	0	0
59	ADRO	07/09/2011	0,02469	0	0	1	0	0
60	ADRO	08/09/2011	-0,01205	0	0	0	1	0
61	ADRO	09/09/2011	-0,01220	0	0	0	0	1
62	ADRO	12/09/2011	-0,02716	1	0	0	0	0
63	ADRO	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
64	ADRO	14/09/2011	-0,00508	0	0	1	0	0
65	ADRO	15/09/2011	-0,01020	0	0	0	1	0
66	ADRO	16/09/2011	0,02062	0	0	0	0	1
67	ADRO	19/09/2011	-0,02020	1	0	0	0	0
68	ADRO	20/09/2011	-0,01031	0	1	0	0	0
69	ADRO	21/09/2011	-0,01042	0	0	1	0	0
70	ADRO	22/09/2011	-0,10000	0	0	0	1	0
71	ADRO	23/09/2011	-0,03509	0	0	0	0	1
72	ADRO	26/09/2011	-0,07879	1	0	0	0	0
73	ADRO	27/09/2011	0,07237	0	1	0	0	0
74	ADRO	28/09/2011	0,03681	0	0	1	0	0
75	ADRO	29/09/2011	0,02367	0	0	0	1	0
76	ADRO	30/09/2011	-0,00578	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
77	ANTM	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
78	ANTM	03/08/2011	-0,01235	0	0	1	0	0
79	ANTM	04/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
80	ANTM	05/08/2011	-0,04000	0	0	0	0	1
81	ANTM	08/08/2011	-0,02604	1	0	0	0	0
82	ANTM	09/08/2011	-0,02674	0	1	0	0	0
83	ANTM	10/08/2011	0,02747	0	0	1	0	0
84	ANTM	11/08/2011	0,02139	0	0	0	1	0
85	ANTM	12/08/2011	0,02618	0	0	0	0	1
86	ANTM	15/08/2011	0,02041	1	0	0	0	0
87	ANTM	16/08/2011	-0,01500	0	1	0	0	0
88	ANTM	18/08/2011	0,01523	0	0	0	1	0
89	ANTM	19/08/2011	-0,03000	0	0	0	0	1
90	ANTM	22/08/2011	0,01031	1	0	0	0	0
91	ANTM	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
92	ANTM	24/08/2011	-0,01020	0	0	1	0	0
93	ANTM	25/08/2011	-0,02577	0	0	0	1	0
94	ANTM	26/08/2011	-0,00529	0	0	0	0	1
95	ANTM	05/09/2011	0,00532	1	0	0	0	0
96	ANTM	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
97	ANTM	07/09/2011	0,03175	0	0	1	0	0
98	ANTM	08/09/2011	-0,00513	0	0	0	1	0
99	ANTM	09/09/2011	-0,02062	0	0	0	0	1
100	ANTM	12/09/2011	-0,02105	1	0	0	0	0
101	ANTM	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
102	ANTM	14/09/2011	-0,02151	0	0	1	0	0
103	ANTM	15/09/2011	-0,02198	0	0	0	1	0
104	ANTM	16/09/2011	0,02247	0	0	0	0	1
105	ANTM	19/09/2011	-0,01648	1	0	0	0	0
106	ANTM	20/09/2011	0,00559	0	1	0	0	0
107	ANTM	21/09/2011	-0,01111	0	0	1	0	0
108	ANTM	22/09/2011	-0,08989	0	0	0	1	0
109	ANTM	23/09/2011	-0,02169	0	0	0	0	1
110	ANTM	26/09/2011	-0,09494	1	0	0	0	0
111	ANTM	27/09/2011	0,02797	0	1	0	0	0
112	ANTM	28/09/2011	-0,01361	0	0	1	0	0
113	ANTM	29/09/2011	-0,00690	0	0	0	1	0
114	ANTM	30/09/2011	0,04167	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
115	ASII	02/08/2011	-0,00628	0	1	0	0	0
116	ASII	03/08/2011	-0,00772	0	0	1	0	0
117	ASII	04/08/2011	-0,00354	0	0	0	1	0
118	ASII	05/08/2011	-0,04545	0	0	0	0	1
119	ASII	08/08/2011	-0,03199	1	0	0	0	0
120	ASII	09/08/2011	-0,01460	0	1	0	0	0
121	ASII	10/08/2011	0,05772	0	0	1	0	0
122	ASII	11/08/2011	-0,00590	0	0	0	1	0
123	ASII	12/08/2011	-0,00371	0	0	0	0	1
124	ASII	15/08/2011	0,04244	1	0	0	0	0
125	ASII	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
126	ASII	18/08/2011	0,03929	0	0	0	1	0
127	ASII	19/08/2011	-0,09141	0	0	0	0	1
128	ASII	22/08/2011	0,02496	1	0	0	0	0
129	ASII	23/08/2011	-0,00738	0	1	0	0	0
130	ASII	24/08/2011	-0,00149	0	0	1	0	0
131	ASII	25/08/2011	0,00372	0	0	0	1	0
132	ASII	26/08/2011	-0,01855	0	0	0	0	1
133	ASII	05/09/2011	0,02494	1	0	0	0	0
134	ASII	06/09/2011	0,01032	0	1	0	0	0
135	ASII	07/09/2011	0,04015	0	0	1	0	0
136	ASII	08/09/2011	-0,00351	0	0	0	1	0
137	ASII	09/09/2011	-0,00986	0	0	0	0	1
138	ASII	12/09/2011	-0,01280	1	0	0	0	0
139	ASII	13/09/2011	0,28242	0	1	0	0	0
140	ASII	14/09/2011	-0,25000	0	0	1	0	0
141	ASII	15/09/2011	-0,02172	0	0	0	1	0
142	ASII	16/09/2011	0,00919	0	0	0	0	1
143	ASII	19/09/2011	-0,01366	1	0	0	0	0
144	ASII	20/09/2011	0,00615	0	1	0	0	0
145	ASII	21/09/2011	-0,02064	0	0	1	0	0
146	ASII	22/09/2011	-0,09446	0	0	0	1	0
147	ASII	23/09/2011	0,01466	0	0	0	0	1
148	ASII	26/09/2011	-0,03144	1	0	0	0	0
149	ASII	27/09/2011	0,06228	0	1	0	0	0
150	ASII	28/09/2011	0,02725	0	0	1	0	0
151	ASII	29/09/2011	0,02974	0	0	0	1	0
152	ASII	30/09/2011	-0,00625	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
153	ASRI	02/08/2011	-0,01136	0	1	0	0	0
154	ASRI	03/08/2011	-0,02299	0	0	1	0	0
155	ASRI	04/08/2011	-0,02353	0	0	0	1	0
156	ASRI	05/08/2011	-0,07229	0	0	0	0	1
157	ASRI	08/08/2011	0,01299	1	0	0	0	0
158	ASRI	09/08/2011	-0,03846	0	1	0	0	0
159	ASRI	10/08/2011	0,08000	0	0	1	0	0
160	ASRI	11/08/2011	0,06173	0	0	0	1	0
161	ASRI	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
162	ASRI	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
163	ASRI	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
164	ASRI	18/08/2011	-0,01163	0	0	0	1	0
165	ASRI	19/08/2011	-0,05882	0	0	0	0	1
166	ASRI	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
167	ASRI	23/08/2011	0,05000	0	1	0	0	0
168	ASRI	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
169	ASRI	25/08/2011	0,02381	0	0	0	1	0
170	ASRI	26/08/2011	-0,02326	0	0	0	0	1
171	ASRI	05/09/2011	0,01190	1	0	0	0	0
172	ASRI	06/09/2011	-0,02353	0	1	0	0	0
173	ASRI	07/09/2011	0,02410	0	0	1	0	0
174	ASRI	08/09/2011	-0,01176	0	0	0	1	0
175	ASRI	09/09/2011	0,04762	0	0	0	0	1
176	ASRI	12/09/2011	-0,04545	1	0	0	0	0
177	ASRI	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
178	ASRI	14/09/2011	-0,01190	0	0	1	0	0
179	ASRI	15/09/2011	0,02410	0	0	0	1	0
180	ASRI	16/09/2011	0,01176	0	0	0	0	1
181	ASRI	19/09/2011	-0,02326	1	0	0	0	0
182	ASRI	20/09/2011	-0,01190	0	1	0	0	0
183	ASRI	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
184	ASRI	22/09/2011	-0,10843	0	0	0	1	0
185	ASRI	23/09/2011	-0,01351	0	0	0	0	1
186	ASRI	26/09/2011	-0,01370	1	0	0	0	0
187	ASRI	27/09/2011	0,04167	0	1	0	0	0
188	ASRI	28/09/2011	-0,01333	0	0	1	0	0
189	ASRI	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
190	ASRI	30/09/2011	0,04054	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
191	BBCA	02/08/2011	0,02339	0	1	0	0	0
192	BBCA	03/08/2011	-0,00571	0	0	1	0	0
193	BBCA	04/08/2011	-0,01149	0	0	0	1	0
194	BBCA	05/08/2011	-0,03488	0	0	0	0	1
195	BBCA	08/08/2011	-0,03012	1	0	0	0	0
196	BBCA	09/08/2011	-0,02484	0	1	0	0	0
197	BBCA	10/08/2011	0,01911	0	0	1	0	0
198	BBCA	11/08/2011	-0,01875	0	0	0	1	0
199	BBCA	12/08/2011	0,01274	0	0	0	0	1
200	BBCA	15/08/2011	0,02516	1	0	0	0	0
201	BBCA	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
202	BBCA	18/08/2011	0,00613	0	0	0	1	0
203	BBCA	19/08/2011	-0,02439	0	0	0	0	1
204	BBCA	22/08/2011	-0,03125	1	0	0	0	0
205	BBCA	23/08/2011	0,02581	0	1	0	0	0
206	BBCA	24/08/2011	-0,00629	0	0	1	0	0
207	BBCA	25/08/2011	0,01266	0	0	0	1	0
208	BBCA	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
209	BBCA	05/09/2011	0,01875	1	0	0	0	0
210	BBCA	06/09/2011	0,00613	0	1	0	0	0
211	BBCA	07/09/2011	0,01829	0	0	1	0	0
212	BBCA	08/09/2011	0,00599	0	0	0	1	0
213	BBCA	09/09/2011	-0,00595	0	0	0	0	1
214	BBCA	12/09/2011	-0,03593	1	0	0	0	0
215	BBCA	13/09/2011	0,00621	0	1	0	0	0
216	BBCA	14/09/2011	-0,04321	0	0	1	0	0
217	BBCA	15/09/2011	0,01935	0	0	0	1	0
218	BBCA	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
219	BBCA	19/09/2011	-0,00633	1	0	0	0	0
220	BBCA	20/09/2011	0,01274	0	1	0	0	0
221	BBCA	21/09/2011	-0,02516	0	0	1	0	0
222	BBCA	22/09/2011	-0,08387	0	0	0	1	0
223	BBCA	23/09/2011	0,05634	0	0	0	0	1
224	BBCA	26/09/2011	-0,02000	1	0	0	0	0
225	BBCA	27/09/2011	0,02041	0	1	0	0	0
226	BBCA	28/09/2011	0,00667	0	0	1	0	0
227	BBCA	29/09/2011	0,01325	0	0	0	1	0
228	BBCA	30/09/2011	0,00654	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
229	BBKP	02/08/2011	-0,02326	0	1	0	0	0
230	BBKP	03/08/2011	0,01190	0	0	1	0	0
231	BBKP	04/08/2011	-0,02353	0	0	0	1	0
232	BBKP	05/08/2011	-0,06024	0	0	0	0	1
233	BBKP	08/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
234	BBKP	09/08/2011	-0,03846	0	1	0	0	0
235	BBKP	10/08/2011	0,02667	0	0	1	0	0
236	BBKP	11/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
237	BBKP	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
238	BBKP	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
239	BBKP	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
240	BBKP	18/08/2011	-0,01299	0	0	0	1	0
241	BBKP	19/08/2011	-0,03947	0	0	0	0	1
242	BBKP	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
243	BBKP	23/08/2011	-0,01370	0	1	0	0	0
244	BBKP	24/08/2011	-0,01389	0	0	1	0	0
245	BBKP	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
246	BBKP	26/08/2011	-0,02817	0	0	0	0	1
247	BBKP	05/09/2011	0,01449	1	0	0	0	0
248	BBKP	06/09/2011	-0,02857	0	1	0	0	0
249	BBKP	07/09/2011	0,02941	0	0	1	0	0
250	BBKP	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
251	BBKP	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
252	BBKP	12/09/2011	-0,04286	1	0	0	0	0
253	BBKP	13/09/2011	0,01493	0	1	0	0	0
254	BBKP	14/09/2011	-0,02941	0	0	1	0	0
255	BBKP	15/09/2011	-0,03030	0	0	0	1	0
256	BBKP	16/09/2011	0,03125	0	0	0	0	1
257	BBKP	19/09/2011	-0,04545	1	0	0	0	0
258	BBKP	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
259	BBKP	21/09/2011	-0,02175	0	0	1	0	0
260	BBKP	22/09/2011	-0,11475	0	0	0	1	0
261	BBKP	23/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
262	BBKP	26/09/2011	-0,07407	1	0	0	0	0
263	BBKP	27/09/2011	0,10000	0	1	0	0	0
264	BBKP	28/09/2011	-0,01818	0	0	1	0	0
265	BBKP	29/09/2011	0,05556	0	0	0	1	0
266	BBKP	30/09/2011	-0,01754	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
267	BBNI	02/08/2011	-0,03279	0	1	0	0	0
268	BBNI	03/08/2011	-0,01130	0	0	1	0	0
269	BBNI	04/08/2011	-0,04000	0	0	0	1	0
270	BBNI	05/08/2011	-0,02381	0	0	0	0	1
271	BBNI	08/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
272	BBNI	09/08/2011	-0,04268	0	1	0	0	0
273	BBNI	10/08/2011	0,03822	0	0	1	0	0
274	BBNI	11/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
275	BBNI	12/08/2011	0,03067	0	0	0	0	1
276	BBNI	15/08/2011	0,02976	1	0	0	0	0
277	BBNI	16/08/2011	0,00578	0	1	0	0	0
278	BBNI	18/08/2011	0,02299	0	0	0	1	0
279	BBNI	19/08/2011	-0,06180	0	0	0	0	1
280	BBNI	22/08/2011	-0,02994	1	0	0	0	0
281	BBNI	23/08/2011	0,02469	0	1	0	0	0
282	BBNI	24/08/2011	-0,01205	0	0	1	0	0
283	BBNI	25/08/2011	0,00610	0	0	0	1	0
284	BBNI	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
285	BBNI	05/09/2011	0,01212	1	0	0	0	0
286	BBNI	06/09/2011	-0,02994	0	1	0	0	0
287	BBNI	07/09/2011	0,02469	0	0	1	0	0
288	BBNI	08/09/2011	0,01205	0	0	0	1	0
289	BBNI	09/09/2011	-0,01786	0	0	0	0	1
290	BBNI	12/09/2011	-0,01818	1	0	0	0	0
291	BBNI	13/09/2011	-0,00617	0	0	0	0	0
292	BBNI	14/09/2011	-0,02484	0	0	1	0	0
293	BBNI	15/09/2011	-0,01274	0	0	0	1	0
294	BBNI	16/09/2011	0,05806	0	0	0	0	1
295	BBNI	19/09/2011	-0,04878	1	0	0	0	0
296	BBNI	20/09/2011	0,00641	0	1	0	0	0
297	BBNI	21/09/2011	-0,01274	0	0	1	0	0
298	BBNI	22/09/2011	-0,14839	0	0	0	1	0
299	BBNI	23/09/2011	0,03788	0	0	0	0	1
300	BBNI	26/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
301	BBNI	27/09/2011	0,03650	0	1	0	0	0
302	BBNI	28/09/2011	0,02817	0	0	1	0	0
303	BBNI	29/09/2011	0,01370	0	0	0	1	0
304	BBNI	30/09/2011	0,00676	0	0	0	0	1



No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
305	BBRI	02/08/2011	0,00694	0	1	0	0	0
306	BBRI	03/08/2011	-0,00690	0	0	1	0	0
307	BBRI	04/08/2011	-0,01389	0	0	0	1	0
308	BBRI	05/08/2011	-0,06338	0	0	0	0	1
309	BBRI	08/08/2011	-0,02256	1	0	0	0	0
310	BBRI	09/08/2011	-0,03077	0	1	0	0	0
311	BBRI	10/08/2011	0,03968	0	0	1	0	0
312	BBRI	11/08/2011	-0,01527	0	0	0	1	0
313	BBRI	12/08/2011	0,00775	0	0	0	0	1
314	BBRI	15/08/2011	0,01538	1	0	0	0	0
315	BBRI	16/08/2011	0,01515	0	1	0	0	0
316	BBRI	18/08/2011	0,02239	0	0	0	1	0
317	BBRI	19/08/2011	-0,06569	0	0	0	0	1
318	BBRI	22/08/2011	-0,00781	1	0	0	0	0
319	BBRI	23/08/2011	0,01575	0	1	0	0	0
320	BBRI	24/08/2011	-0,00775	0	0	1	0	0
321	BBRI	25/08/2011	0,01563	0	0	0	1	0
322	BBRI	26/08/2011	0,00769	0	0	0	0	1
323	BBRI	05/09/2011	0,01527	1	0	0	0	0
324	BBRI	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
325	BBRI	07/09/2011	0,03008	0	0	1	0	0
326	BBRI	08/09/2011	0,01460	0	0	0	1	0
327	BBRI	09/09/2011	-0,01439	0	0	0	0	1
328	BBRI	12/09/2011	-0,03650	1	0	0	0	0
329	BBRI	13/09/2011	-0,03030	0	1	0	0	0
330	BBRI	14/09/2011	-0,03906	0	0	1	0	0
331	BBRI	15/09/2011	0,02439	0	0	0	1	0
332	BBRI	16/09/2011	0,02381	0	0	0	0	1
333	BBRI	19/09/2011	-0,04651	1	0	0	0	0
334	BBRI	20/09/2011	0,00813	0	1	0	0	0
335	BBRI	21/09/2011	-0,01613	0	0	1	0	0
336	BBRI	22/09/2011	-0,13115	0	0	0	1	0
337	BBRI	23/09/2011	0,05650	0	0	0	0	1
338	BBRI	26/09/2011	-0,04464	1	0	0	0	0
339	BBRI	27/09/2011	0,07477	0	1	0	0	0
340	BBRI	28/09/2011	0,02609	0	0	1	0	0
341	BBRI	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
342	BBRI	30/09/2011	-0,00847	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
343	BBTN	02/08/2011	-0,01156	0	1	0	0	0
344	BBTN	03/08/2011	-0,01754	0	0	1	0	0
345	BBTN	04/08/2011	-0,00595	0	0	0	1	0
346	BBTN	05/08/2011	-0,05988	0	0	0	0	1
347	BBTN	08/08/2011	-0,03822	1	0	0	0	0
348	BBTN	09/08/2011	-0,03311	0	1	0	0	0
349	BBTN	10/08/2011	0,04795	0	0	1	0	0
350	BBTN	11/08/2011	0,01307	0	0	0	1	0
351	BBTN	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
352	BBTN	15/08/2011	0,01290	1	0	0	0	0
353	BBTN	16/08/2011	0,01274	0	1	0	0	0
354	BBTN	18/08/2011	0,03774	0	0	0	1	0
355	BBTN	19/08/2011	-0,02424	0	0	0	0	1
356	BBTN	22/08/2011	-0,01242	1	0	0	0	0
357	BBTN	23/08/2011	0,02516	0	1	0	0	0
358	BBTN	24/08/2011	-0,01227	0	0	1	0	0
359	BBTN	25/08/2011	-0,01242	0	0	0	1	0
360	BBTN	26/08/2011	-0,01887	0	0	0	0	1
361	BBTN	05/09/2011	-0,00641	1	0	0	0	0
362	BBTN	06/09/2011	-0,00645	0	1	0	0	0
363	BBTN	07/09/2011	0,03896	0	0	1	0	0
364	BBTN	08/09/2011	-0,01250	0	0	0	1	0
365	BBTN	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
366	BBTN	12/09/2011	-0,01899	1	0	0	0	0
367	BBTN	13/09/2011	-0,02581	0	0	1	0	0
368	BBTN	14/09/2011	-0,01325	0	0	0	0	0
369	BBTN	15/09/2011	-0,02013	0	0	0	1	0
370	BBTN	16/09/2011	-0,00685	0	0	0	0	1
371	BBTN	19/09/2011	-0,04138	1	0	0	0	0
372	BBTN	20/09/2011	-0,03597	0	1	0	0	0
373	BBTN	21/09/2011	-0,03731	0	0	1	0	0
374	BBTN	22/09/2011	-0,17829	0	0	0	1	0
375	BBTN	23/09/2011	0,06604	0	0	0	0	1
376	BBTN	26/09/2011	-0,02655	1	0	0	0	0
377	BBTN	27/09/2011	0,06364	0	1	0	0	0
378	BBTN	28/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
379	BBTN	29/09/2011	0,01709	0	0	0	1	0
380	BBTN	30/09/2011	0,01681	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
381	BDMN	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
382	BDMN	03/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
383	BDMN	04/08/2011	-0,00901	0	0	0	1	0
384	BDMN	05/08/2011	-0,04509	0	0	0	0	1
385	BDMN	08/08/2011	-0,01885	1	0	0	0	0
386	BDMN	09/08/2011	-0,04793	0	1	0	0	0
387	BDMN	10/08/2011	0,02018	0	0	1	0	0
388	BDMN	11/08/2011	0,00979	0	0	0	1	0
389	BDMN	12/08/2011	0,04907	0	0	0	0	1
390	BDMN	15/08/2011	0,02810	1	0	0	0	0
391	BDMN	16/08/2011	-0,01816	0	1	0	0	0
392	BDMN	18/08/2011	0,00915	0	0	0	1	0
393	BDMN	19/08/2011	-0,04592	0	0	0	0	1
394	BDMN	22/08/2011	-0,03842	1	0	0	0	0
395	BDMN	23/08/2011	0,03996	0	1	0	0	0
396	BDMN	24/08/2011	-0,00951	0	0	1	0	0
397	BDMN	25/08/2011	-0,00980	0	0	0	1	0
398	BDMN	26/08/2011	0,01959	0	0	0	0	1
399	BDMN	05/09/2011	0,04813	1	0	0	0	0
400	BDMN	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
401	BDMN	07/09/2011	0,03666	0	0	1	0	0
402	BDMN	08/09/2011	0,00255	0	0	0	1	0
403	BDMN	09/09/2011	-0,02727	0	0	0	0	1
404	BDMN	12/09/2011	-0,01869	1	0	0	0	0
405	BDMN	13/09/2011	-0,02857	0	1	0	0	0
406	BDMN	14/09/2011	0,01961	0	0	1	0	0
407	BDMN	15/09/2011	-0,04808	0	0	0	1	0
408	BDMN	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
409	BDMN	19/09/2011	-0,01515	1	0	0	0	0
410	BDMN	20/09/2011	-0,00513	0	1	0	0	0
411	BDMN	21/09/2011	0,01031	0	0	1	0	0
412	BDMN	22/09/2011	-0,06633	0	0	0	1	0
413	BDMN	23/09/2011	0,04372	0	0	0	0	1
414	BDMN	26/09/2011	-0,06806	1	0	0	0	0
415	BDMN	27/09/2011	0,02809	0	1	0	0	0
416	BDMN	28/09/2011	-0,01093	0	0	1	0	0
417	BDMN	29/09/2011	0,01105	0	0	0	1	0
418	BDMN	30/09/2011	0,00546	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
419	BJBR	02/08/2011	-0,01613	0	1	0	0	0
420	BJBR	03/08/2011	-0,01639	0	0	1	0	0
421	BJBR	04/08/2011	-0,00833	0	0	0	1	0
422	BJBR	05/08/2011	-0,06723	0	0	0	0	1
423	BJBR	08/08/2011	-0,01802	1	0	0	0	0
424	BJBR	09/08/2011	-0,02752	0	1	0	0	0
425	BJBR	10/08/2011	0,04717	0	0	1	0	0
426	BJBR	11/08/2011	-0,00901	0	0	0	1	0
427	BJBR	12/08/2011	0,00909	0	0	0	0	1
428	BJBR	15/08/2011	0,01802	1	0	0	0	0
429	BJBR	16/08/2011	-0,00885	0	1	0	0	0
430	BJBR	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
431	BJBR	19/08/2011	-0,05357	0	0	0	0	1
432	BJBR	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
433	BJBR	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
434	BJBR	24/08/2011	-0,00943	0	0	1	0	0
435	BJBR	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
436	BJBR	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
437	BJBR	05/09/2011	0,01905	1	0	0	0	0
438	BJBR	06/09/2011	0,02804	0	1	0	0	0
439	BJBR	07/09/2011	0,01818	0	0	1	0	0
440	BJBR	08/09/2011	-0,00893	0	0	0	1	0
441	BJBR	09/09/2011	-0,00901	0	0	0	0	1
442	BJBR	12/09/2011	-0,03636	1	0	0	0	0
443	BJBR	13/09/2011	-0,00943	0	1	0	0	0
444	BJBR	14/09/2011	-0,00952	0	0	1	0	0
445	BJBR	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
446	BJBR	16/09/2011	0,00962	0	0	0	0	1
447	BJBR	19/09/2011	-0,02857	1	0	0	0	0
448	BJBR	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
449	BJBR	21/09/2011	-0,01961	0	0	1	0	0
450	BJBR	22/09/2011	-0,14000	0	0	0	1	0
451	BJBR	23/09/2011	0,01163	0	0	0	0	1
452	BJBR	26/09/2011	-0,04598	1	0	0	0	0
453	BJBR	27/09/2011	0,08434	0	1	0	0	0
454	BJBR	28/09/2011	-0,02222	0	0	1	0	0
455	BJBR	29/09/2011	0,03409	0	0	0	1	0
456	BJBR	30/09/2011	-0,01099	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
457	BMRI	02/08/2011	-0,01863	0	1	0	0	0
458	BMRI	03/08/2011	-0,03165	0	0	1	0	0
459	BMRI	04/08/2011	0,00654	0	0	0	1	0
460	BMRI	05/08/2011	-0,04545	0	0	0	0	1
461	BMRI	08/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
462	BMRI	09/08/2011	-0,02041	0	1	0	0	0
463	BMRI	10/08/2011	0,04167	0	0	1	0	0
464	BMRI	11/08/2011	-0,02667	0	0	0	1	0
465	BMRI	12/08/2011	-0,01370	0	0	0	0	1
466	BMRI	15/08/2011	0,01389	1	0	0	0	0
467	BMRI	16/08/2011	-0,00685	0	1	0	0	0
468	BMRI	18/08/2011	0,01379	0	0	0	1	0
469	BMRI	19/08/2011	-0,05442	0	0	0	0	1
470	BMRI	22/08/2011	-0,02158	1	0	0	0	0
471	BMRI	23/08/2011	0,01471	0	1	0	0	0
472	BMRI	24/08/2011	-0,00725	0	0	1	0	0
473	BMRI	25/08/2011	0,00730	0	0	0	1	0
474	BMRI	26/08/2011	-0,00725	0	0	0	0	1
475	BMRI	05/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
476	BMRI	06/09/2011	-0,00730	0	1	0	0	0
477	BMRI	07/09/2011	0,04412	0	0	1	0	0
478	BMRI	08/09/2011	0,01408	0	0	0	1	0
479	BMRI	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
480	BMRI	12/09/2011	-0,04167	1	0	0	0	0
481	BMRI	13/09/2011	-0,00725	0	0	0	0	0
482	BMRI	14/09/2011	-0,05839	0	0	1	0	0
483	BMRI	15/09/2011	-0,01550	0	0	0	1	0
484	BMRI	16/09/2011	0,04724	0	0	0	0	1
485	BMRI	19/09/2011	-0,04511	1	0	0	0	0
486	BMRI	20/09/2011	-0,00787	0	1	0	0	0
487	BMRI	21/09/2011	-0,01587	0	0	1	0	0
488	BMRI	22/09/2011	-0,14516	0	0	0	1	0
489	BMRI	23/09/2011	0,05660	0	0	0	0	1
490	BMRI	26/09/2011	-0,01786	1	0	0	0	0
491	BMRI	27/09/2011	0,08182	0	1	0	0	0
492	BMRI	28/09/2011	0,04202	0	0	1	0	0
493	BMRI	29/09/2011	0,04032	0	0	0	1	0
494	BMRI	30/09/2011	-0,02326	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
495	BNBR	02/08/2011	0,01408	0	1	0	0	0
496	BNBR	03/08/2011	-0,01389	0	0	1	0	0
497	BNBR	04/08/2011	-0,01408	0	0	0	1	0
498	BNBR	05/08/2011	-0,08571	0	0	0	0	1
499	BNBR	08/08/2011	-0,01563	1	0	0	0	0
500	BNBR	09/08/2011	-0,04762	0	1	0	0	0
501	BNBR	10/08/2011	0,03333	0	0	1	0	0
502	BNBR	11/08/2011	0,04839	0	0	0	1	0
503	BNBR	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
504	BNBR	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
505	BNBR	16/08/2011	0,01538	0	1	0	0	0
506	BNBR	18/08/2011	0,04545	0	0	0	1	0
507	BNBR	19/08/2011	-0,05797	0	0	0	0	1
508	BNBR	22/08/2011	0,01538	1	0	0	0	0
509	BNBR	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
510	BNBR	24/08/2011	-0,03030	0	0	1	0	0
511	BNBR	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
512	BNBR	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
513	BNBR	05/09/2011	-0,01563	1	0	0	0	0
514	BNBR	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
515	BNBR	07/09/2011	0,03175	0	0	1	0	0
516	BNBR	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
517	BNBR	09/09/2011	-0,01538	0	0	0	0	1
518	BNBR	12/09/2011	-0,01563	1	0	0	0	0
519	BNBR	13/09/2011	-0,01587	0	1	0	0	0
520	BNBR	14/09/2011	-0,01613	0	0	1	0	0
521	BNBR	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
522	BNBR	16/09/2011	0,01639	0	0	0	0	1
523	BNBR	19/09/2011	-0,03226	1	0	0	0	0
524	BNBR	20/09/2011	0,01667	0	1	0	0	0
525	BNBR	21/09/2011	-0,01639	0	0	1	0	0
526	BNBR	22/09/2011	-0,10000	0	0	0	1	0
527	BNBR	23/09/2011	0,01852	0	0	0	0	1
528	BNBR	26/09/2011	0,07273	1	0	0	0	0
529	BNBR	27/09/2011	0,03922	0	1	0	0	0
530	BNBR	28/09/2011	-0,01887	0	0	1	0	0
531	BNBR	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
532	BNBR	30/09/2011	-0,01923	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
533	BRAU	02/08/2011	0,01852	0	1	0	0	0
534	BRAU	03/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
535	BRAU	04/08/2011	-0,01818	0	0	0	1	0
536	BRAU	05/08/2011	-0,05556	0	0	0	0	1
537	BRAU	08/08/2011	-0,03922	1	0	0	0	0
538	BRAU	09/08/2011	-0,01020	0	1	0	0	0
539	BRAU	10/08/2011	0,07216	0	0	1	0	0
540	BRAU	11/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
541	BRAU	12/08/2011	-0,01923	0	0	0	0	1
542	BRAU	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
543	BRAU	16/08/2011	0,01961	0	1	0	0	0
544	BRAU	18/08/2011	0,05769	0	0	0	1	0
545	BRAU	19/08/2011	-0,01818	0	0	0	0	1
546	BRAU	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
547	BRAU	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
548	BRAU	24/08/2011	-0,01852	0	0	1	0	0
549	BRAU	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
550	BRAU	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
551	BRAU	05/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
552	BRAU	06/09/2011	-0,01887	0	1	0	0	0
553	BRAU	07/09/2011	0,03846	0	0	1	0	0
554	BRAU	08/09/2011	-0,01852	0	0	0	1	0
555	BRAU	09/09/2011	-0,01887	0	0	0	0	1
556	BRAU	12/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
557	BRAU	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
558	BRAU	14/09/2011	-0,03846	0	0	1	0	0
559	BRAU	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
560	BRAU	16/09/2011	0,02000	0	0	0	0	1
561	BRAU	19/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
562	BRAU	20/09/2011	-0,01961	0	1	0	0	0
563	BRAU	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
564	BRAU	22/09/2011	-0,12000	0	0	0	1	0
565	BRAU	23/09/2011	0,03409	0	0	0	0	1
566	BRAU	26/09/2011	-0,02198	1	0	0	0	0
567	BRAU	27/09/2011	0,03371	0	1	0	0	0
568	BRAU	28/09/2011	-0,01087	0	0	1	0	0
569	BRAU	29/09/2011	-0,04396	0	0	0	1	0
570	BRAU	30/09/2011	-0,01149	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
571	BSDE	02/08/2011	-0,01869	0	1	0	0	0
572	BSDE	03/08/2011	-0,02857	0	0	1	0	0
573	BSDE	04/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
574	BSDE	05/08/2011	-0,05882	0	0	0	0	1
575	BSDE	08/08/2011	-0,04167	1	0	0	0	0
576	BSDE	09/08/2011	-0,03261	0	1	0	0	0
577	BSDE	10/08/2011	0,06742	0	0	1	0	0
578	BSDE	11/08/2011	0,06316	0	0	0	1	0
579	BSDE	12/08/2011	0,00990	0	0	0	0	1
580	BSDE	15/08/2011	0,00980	1	0	0	0	0
581	BSDE	16/08/2011	0,01942	0	1	0	0	0
582	BSDE	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
583	BSDE	19/08/2011	-0,04762	0	0	0	0	1
584	BSDE	22/08/2011	-0,02000	1	0	0	0	0
585	BSDE	23/08/2011	0,02041	0	1	0	0	0
586	BSDE	24/08/2011	0,04000	0	0	1	0	0
587	BSDE	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
588	BSDE	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
589	BSDE	05/09/2011	-0,01923	1	0	0	0	0
590	BSDE	06/09/2011	-0,01961	0	1	0	0	0
591	BSDE	07/09/2011	0,01000	0	0	1	0	0
592	BSDE	08/09/2011	-0,00990	0	0	0	1	0
593	BSDE	09/09/2011	-0,01000	0	0	0	0	1
594	BSDE	12/09/2011	-0,01010	1	0	0	0	0
595	BSDE	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
596	BSDE	14/09/2011	-0,05102	0	0	1	0	0
597	BSDE	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
598	BSDE	16/09/2011	0,03226	0	0	0	0	1
599	BSDE	19/09/2011	-0,03125	1	0	0	0	0
600	BSDE	20/09/2011	-0,03226	0	1	0	0	0
601	BSDE	21/09/2011	-0,02222	0	0	1	0	0
602	BSDE	22/09/2011	-0,06818	0	0	0	1	0
603	BSDE	23/09/2011	-0,02439	0	0	0	0	1
604	BSDE	26/09/2011	-0,07500	1	0	0	0	0
605	BSDE	27/09/2011	0,08108	0	1	0	0	0
606	BSDE	28/09/2011	0,02500	0	0	1	0	0
607	BSDE	29/09/2011	0,03659	0	0	0	1	0
608	BSDE	30/09/2011	0,02353	0	0	0	0	1



No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
609	BTEL	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
610	BTEL	03/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
611	BTEL	04/08/2011	-0,04225	0	0	0	1	0
612	BTEL	05/08/2011	-0,01471	0	0	0	0	1
613	BTEL	08/08/2011	-0,01493	1	0	0	0	0
614	BTEL	09/08/2011	-0,06061	0	1	0	0	0
615	BTEL	10/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
616	BTEL	11/08/2011	0,11290	0	0	0	1	0
617	BTEL	12/08/2011	-0,04348	0	0	0	0	1
618	BTEL	15/08/2011	-0,01515	1	0	0	0	0
619	BTEL	16/08/2011	0,04615	0	1	0	0	0
620	BTEL	18/08/2011	0,14706	0	0	0	1	0
621	BTEL	19/08/2011	-0,07692	0	0	0	0	1
622	BTEL	22/08/2011	-0,01389	1	0	0	0	0
623	BTEL	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
624	BTEL	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
625	BTEL	25/08/2011	0,01408	0	0	0	1	0
626	BTEL	26/08/2011	0,02778	0	0	0	0	1
627	BTEL	05/09/2011	0,02703	1	0	0	0	0
628	BTEL	06/09/2011	-0,01316	0	1	0	0	0
629	BTEL	07/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
630	BTEL	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
631	BTEL	09/09/2011	-0,01333	0	0	0	0	1
632	BTEL	12/09/2011	-0,01351	1	0	0	0	0
633	BTEL	13/09/2011	-0,02740	0	1	0	0	0
634	BTEL	14/09/2011	0,01408	0	0	1	0	0
635	BTEL	15/09/2011	-0,01389	0	0	0	1	0
636	BTEL	16/09/2011	-0,01408	0	0	0	0	1
637	BTEL	19/09/2011	0,01429	1	0	0	0	0
638	BTEL	20/09/2011	-0,01408	0	1	0	0	0
639	BTEL	21/09/2011	-0,01429	0	0	1	0	0
640	BTEL	22/09/2011	-0,01449	0	0	0	1	0
641	BTEL	23/09/2011	-0,02941	0	0	0	0	1
642	BTEL	26/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
643	BTEL	27/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
644	BTEL	28/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
645	BTEL	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
646	BTEL	30/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
647	BUMI	02/08/2011	0,03200	0	1	0	0	0
648	BUMI	03/08/2011	-0,00775	0	0	1	0	0
649	BUMI	04/08/2011	-0,01563	0	0	0	1	0
650	BUMI	05/08/2011	-0,07143	0	0	0	0	1
651	BUMI	08/08/2011	-0,05128	1	0	0	0	0
652	BUMI	09/08/2011	-0,06306	0	1	0	0	0
653	BUMI	10/08/2011	0,03846	0	0	1	0	0
654	BUMI	11/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
655	BUMI	12/08/2011	-0,01852	0	0	0	0	1
656	BUMI	15/08/2011	0,01887	1	0	0	0	0
657	BUMI	16/08/2011	0,00926	0	1	0	0	0
658	BUMI	18/08/2011	0,00917	0	0	0	1	0
659	BUMI	19/08/2011	-0,01818	0	0	0	0	1
660	BUMI	22/08/2011	-0,03704	1	0	0	0	0
661	BUMI	23/08/2011	-0,01346	0	1	0	0	0
662	BUMI	24/08/2011	0,00390	0	0	1	0	0
663	BUMI	25/08/2011	-0,01942	0	0	0	1	0
664	BUMI	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
665	BUMI	05/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
666	BUMI	06/09/2011	0,01980	0	1	0	0	0
667	BUMI	07/09/2011	0,05825	0	0	1	0	0
668	BUMI	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
669	BUMI	09/09/2011	0,02752	0	0	0	0	1
670	BUMI	12/09/2011	-0,04464	1	0	0	0	0
671	BUMI	13/09/2011	0,01869	0	1	0	0	0
672	BUMI	14/09/2011	-0,03670	0	0	1	0	0
673	BUMI	15/09/2011	-0,00952	0	0	0	1	0
674	BUMI	16/09/2011	0,03846	0	0	0	0	1
675	BUMI	19/09/2011	-0,01852	1	0	0	0	0
676	BUMI	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
677	BUMI	21/09/2011	-0,02830	0	0	1	0	0
678	BUMI	22/09/2011	-0,11621	0	0	0	1	0
679	BUMI	23/09/2011	0,03133	0	0	0	0	1
680	BUMI	26/09/2011	-0,08046	1	0	0	0	0
681	BUMI	27/09/2011	0,06250	0	1	0	0	0
682	BUMI	28/09/2011	-0,03529	0	0	1	0	0
683	BUMI	29/09/2011	-0,05854	0	0	0	1	0
684	BUMI	30/09/2011	0,01036	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
685	CPIN	02/08/2011	-0,06481	0	1	0	0	0
686	CPIN	03/08/2011	0,08911	0	0	1	0	0
687	CPIN	04/08/2011	0,03636	0	0	0	1	0
688	CPIN	05/08/2011	-0,07895	0	0	0	0	1
689	CPIN	08/08/2011	-0,04762	1	0	0	0	0
690	CPIN	09/08/2011	-0,01000	0	1	0	0	0
691	CPIN	10/08/2011	0,04040	0	0	1	0	0
692	CPIN	11/08/2011	-0,00971	0	0	0	1	0
693	CPIN	12/08/2011	0,01961	0	0	0	0	1
694	CPIN	15/08/2011	0,04808	1	0	0	0	0
695	CPIN	16/08/2011	-0,00917	0	1	0	0	0
696	CPIN	18/08/2011	0,01852	0	0	0	1	0
697	CPIN	19/08/2011	-0,04545	0	0	0	0	1
698	CPIN	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
699	CPIN	23/08/2011	0,06667	0	1	0	0	0
700	CPIN	24/08/2011	0,01786	0	0	1	0	0
701	CPIN	25/08/2011	-0,05263	0	0	0	1	0
702	CPIN	26/08/2011	0,01852	0	0	0	0	1
703	CPIN	05/09/2011	-0,01818	1	0	0	0	0
704	CPIN	06/09/2011	0,04630	0	1	0	0	0
705	CPIN	07/09/2011	0,04425	0	0	1	0	0
706	CPIN	08/09/2011	-0,02542	0	0	0	1	0
707	CPIN	09/09/2011	-0,02609	0	0	0	0	1
708	CPIN	12/09/2011	-0,01786	1	0	0	0	0
709	CPIN	13/09/2011	0,00909	0	1	0	0	0
710	CPIN	14/09/2011	-0,04505	0	0	1	0	0
711	CPIN	15/09/2011	-0,01887	0	0	0	1	0
712	CPIN	16/09/2011	0,05769	0	0	0	0	1
713	CPIN	19/09/2011	-0,02727	1	0	0	0	0
714	CPIN	20/09/2011	0,02804	0	1	0	0	0
715	CPIN	21/09/2011	-0,04545	0	0	1	0	0
716	CPIN	22/09/2011	-0,16190	0	0	0	1	0
717	CPIN	23/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
718	CPIN	26/09/2011	-0,07955	1	0	0	0	0
719	CPIN	27/09/2011	0,19753	0	1	0	0	0
720	CPIN	28/09/2011	-0,02062	0	0	1	0	0
721	CPIN	29/09/2011	0,01053	0	0	0	1	0
722	CPIN	30/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
723	DOID	02/08/2011	0,02128	0	1	0	0	0
724	DOID	03/08/2011	-0,01042	0	0	1	0	0
725	DOID	04/08/2011	-0,02105	0	0	0	1	0
726	DOID	05/08/2011	-0,10753	0	0	0	0	1
727	DOID	08/08/2011	-0,02410	1	0	0	0	0
728	DOID	09/08/2011	-0,04938	0	1	0	0	0
729	DOID	10/08/2011	0,03896	0	0	1	0	0
730	DOID	11/08/2011	0,06250	0	0	0	1	0
731	DOID	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
732	DOID	15/08/2011	0,01176	1	0	0	0	0
733	DOID	16/08/2011	0,02326	0	1	0	0	0
734	DOID	18/08/2011	0,04545	0	0	0	1	0
735	DOID	19/08/2011	-0,06522	0	0	0	0	1
736	DOID	22/08/2011	0,02326	1	0	0	0	0
737	DOID	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
738	DOID	24/08/2011	-0,01136	0	0	1	0	0
739	DOID	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
740	DOID	26/08/2011	-0,01149	0	0	0	0	1
741	DOID	05/09/2011	-0,02326	1	0	0	0	0
742	DOID	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
743	DOID	07/09/2011	0,04762	0	0	1	0	0
744	DOID	08/09/2011	-0,01136	0	0	0	1	0
745	DOID	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
746	DOID	12/09/2011	-0,03448	1	0	0	0	0
747	DOID	13/09/2011	-0,01190	0	1	0	0	0
748	DOID	14/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
749	DOID	15/09/2011	-0,01205	0	0	0	1	0
750	DOID	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
751	DOID	19/09/2011	-0,06098	1	0	0	0	0
752	DOID	20/09/2011	0,02597	0	1	0	0	0
753	DOID	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
754	DOID	22/09/2011	-0,11392	0	0	0	1	0
755	DOID	23/09/2011	-0,02857	0	0	0	0	1
756	DOID	26/09/2011	-0,04412	1	0	0	0	0
757	DOID	27/09/2011	0,07692	0	1	0	0	0
758	DOID	28/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
759	DOID	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
760	DOID	30/09/2011	-0,01429	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
761	ELSA	02/08/2011	-0,01724	0	1	0	0	0
762	ELSA	03/08/2011	-0,01754	0	0	1	0	0
763	ELSA	04/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
764	ELSA	05/08/2011	-0,07143	0	0	0	0	1
765	ELSA	08/08/2011	-0,05769	1	0	0	0	0
766	ELSA	09/08/2011	-0,04082	0	1	0	0	0
767	ELSA	10/08/2011	0,02128	0	0	1	0	0
768	ELSA	11/08/2011	0,02083	0	0	0	1	0
769	ELSA	12/08/2011	0,02041	0	0	0	0	1
770	ELSA	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
771	ELSA	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
772	ELSA	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
773	ELSA	19/08/2011	-0,08000	0	0	0	0	1
774	ELSA	22/08/2011	0,04348	1	0	0	0	0
775	ELSA	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
776	ELSA	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
777	ELSA	25/08/2011	-0,02083	0	0	0	1	0
778	ELSA	26/08/2011	0,02128	0	0	0	0	1
779	ELSA	05/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
780	ELSA	06/09/2011	-0,02083	0	1	0	0	0
781	ELSA	07/09/2011	0,06383	0	0	1	0	0
782	ELSA	08/09/2011	-0,04000	0	0	0	1	0
783	ELSA	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
784	ELSA	12/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
785	ELSA	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
786	ELSA	14/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
787	ELSA	15/09/2011	-0,02083	0	0	0	1	0
788	ELSA	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
789	ELSA	19/09/2011	-0,02128	1	0	0	0	0
790	ELSA	20/09/2011	-0,02174	0	1	0	0	0
791	ELSA	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
792	ELSA	22/09/2011	-0,11111	0	0	0	1	0
793	ELSA	23/09/2011	-0,02500	0	0	0	0	1
794	ELSA	26/09/2011	-0,04390	1	0	0	0	0
795	ELSA	27/09/2011	0,07143	0	1	0	0	0
796	ELSA	28/09/2011	-0,04762	0	0	1	0	0
797	ELSA	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
798	ELSA	30/09/2011	-0,01000	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
799	ELTY	02/08/2011	-0,00571	0	1	0	0	0
800	ELTY	03/08/2011	-0,02874	0	0	1	0	0
801	ELTY	04/08/2011	-0,03550	0	0	0	1	0
802	ELTY	05/08/2011	-0,07975	0	0	0	0	1
803	ELTY	08/08/2011	0,01333	1	0	0	0	0
804	ELTY	09/08/2011	-0,07237	0	1	0	0	0
805	ELTY	10/08/2011	0,04965	0	0	1	0	0
806	ELTY	11/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
807	ELTY	12/08/2011	-0,00676	0	0	0	0	1
808	ELTY	15/08/2011	0,01361	1	0	0	0	0
809	ELTY	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
810	ELTY	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
811	ELTY	19/08/2011	-0,04027	0	0	0	0	1
812	ELTY	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
813	ELTY	23/08/2011	-0,00699	0	1	0	0	0
814	ELTY	24/08/2011	0,02113	0	0	1	0	0
815	ELTY	25/08/2011	-0,01379	0	0	0	1	0
816	ELTY	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
817	ELTY	05/09/2011	-0,00699	1	0	0	0	0
818	ELTY	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
819	ELTY	07/09/2011	0,03521	0	0	1	0	0
820	ELTY	08/09/2011	-0,01361	0	0	0	1	0
821	ELTY	09/09/2011	-0,00690	0	0	0	0	1
822	ELTY	12/09/2011	-0,03472	1	0	0	0	0
823	ELTY	13/09/2011	0,00719	0	1	0	0	0
824	ELTY	14/09/2011	-0,03571	0	0	1	0	0
825	ELTY	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
826	ELTY	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
827	ELTY	19/09/2011	-0,02963	1	0	0	0	0
828	ELTY	20/09/2011	0,03817	0	1	0	0	0
829	ELTY	21/09/2011	-0,02941	0	0	1	0	0
830	ELTY	22/09/2011	-0,06818	0	0	0	1	0
831	ELTY	23/09/2011	-0,00813	0	0	0	0	1
832	ELTY	26/09/2011	-0,11475	1	0	0	0	0
833	ELTY	27/09/2011	0,09259	0	1	0	0	0
834	ELTY	28/09/2011	-0,02542	0	0	1	0	0
835	ELTY	29/09/2011	-0,02609	0	0	0	1	0
836	ELTY	30/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
837	ENRG	02/08/2011	-0,01887	0	1	0	0	0
838	ENRG	03/08/2011	-0,01923	0	0	1	0	0
839	ENRG	04/08/2011	-0,05882	0	0	0	1	0
840	ENRG	05/08/2011	-0,12500	0	0	0	0	1
841	ENRG	08/08/2011	-0,02381	1	0	0	0	0
842	ENRG	09/08/2011	-0,08293	0	1	0	0	0
843	ENRG	10/08/2011	0,04255	0	0	1	0	0
844	ENRG	11/08/2011	0,02041	0	0	0	1	0
845	ENRG	12/08/2011	0,02500	0	0	0	0	1
846	ENRG	15/08/2011	0,02439	1	0	0	0	0
847	ENRG	16/08/2011	-0,04762	0	1	0	0	0
848	ENRG	18/08/2011	0,02500	0	0	0	1	0
849	ENRG	19/08/2011	-0,07317	0	0	0	0	1
850	ENRG	22/08/2011	0,02105	1	0	0	0	0
851	ENRG	23/08/2011	0,02062	0	1	0	0	0
852	ENRG	24/08/2011	-0,02020	0	0	1	0	0
853	ENRG	25/08/2011	-0,01546	0	0	0	1	0
854	ENRG	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
855	ENRG	05/09/2011	-0,00524	1	0	0	0	0
856	ENRG	06/09/2011	0,01053	0	1	0	0	0
857	ENRG	07/09/2011	0,02604	0	0	1	0	0
858	ENRG	08/09/2011	-0,01523	0	0	0	1	0
859	ENRG	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
860	ENRG	12/09/2011	-0,03608	1	0	0	0	0
861	ENRG	13/09/2011	-0,00535	0	1	0	0	0
862	ENRG	14/09/2011	-0,01075	0	0	1	0	0
863	ENRG	15/09/2011	-0,03261	0	0	0	1	0
864	ENRG	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
865	ENRG	19/09/2011	-0,07303	1	0	0	0	0
866	ENRG	20/09/2011	0,06061	0	1	0	0	0
867	ENRG	21/09/2011	-0,04000	0	0	1	0	0
868	ENRG	22/09/2011	-0,11310	0	0	0	1	0
869	ENRG	23/09/2011	-0,00671	0	0	0	0	1
870	ENRG	26/09/2011	-0,10811	1	0	0	0	0
871	ENRG	27/09/2011	0,11364	0	1	0	0	0
872	ENRG	28/09/2011	-0,04762	0	0	1	0	0
873	ENRG	29/09/2011	-0,02143	0	0	0	1	0
874	ENRG	30/09/2011	-0,03650	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
875	GGRM	02/08/2011	0,00472	0	1	0	0	0
876	GGRM	03/08/2011	-0,02347	0	0	1	0	0
877	GGRM	04/08/2011	0,01346	0	0	0	1	0
878	GGRM	05/08/2011	-0,02941	0	0	0	0	1
879	GGRM	08/08/2011	-0,02248	1	0	0	0	0
880	GGRM	09/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
881	GGRM	10/08/2011	0,01900	0	0	1	0	0
882	GGRM	11/08/2011	0,03925	0	0	0	1	0
883	GGRM	12/08/2011	0,03777	0	0	0	0	1
884	GGRM	15/08/2011	-0,00728	1	0	0	0	0
885	GGRM	16/08/2011	-0,00642	0	1	0	0	0
886	GGRM	18/08/2011	0,03321	0	0	0	1	0
887	GGRM	19/08/2011	-0,05357	0	0	0	0	1
888	GGRM	22/08/2011	0,01792	1	0	0	0	0
889	GGRM	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
890	GGRM	24/08/2011	0,00093	0	0	1	0	0
891	GGRM	25/08/2011	0,00278	0	0	0	1	0
892	GGRM	26/08/2011	0,01570	0	0	0	0	1
893	GGRM	05/09/2011	0,01091	1	0	0	0	0
894	GGRM	06/09/2011	0,01799	0	1	0	0	0
895	GGRM	07/09/2011	0,03710	0	0	1	0	0
896	GGRM	08/09/2011	0,01107	0	0	0	1	0
897	GGRM	09/09/2011	0,00758	0	0	0	0	1
898	GGRM	12/09/2011	-0,04264	1	0	0	0	0
899	GGRM	13/09/2011	0,01310	0	1	0	0	0
900	GGRM	14/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
901	GGRM	15/09/2011	-0,03621	0	0	0	1	0
902	GGRM	16/09/2011	0,00447	0	0	0	0	1
903	GGRM	19/09/2011	-0,01158	1	0	0	0	0
904	GGRM	20/09/2011	-0,01802	0	1	0	0	0
905	GGRM	21/09/2011	-0,02569	0	0	1	0	0
906	GGRM	22/09/2011	-0,05273	0	0	0	1	0
907	GGRM	23/09/2011	-0,00396	0	0	0	0	1
908	GGRM	26/09/2011	-0,02000	1	0	0	0	0
909	GGRM	27/09/2011	0,05306	0	1	0	0	0
910	GGRM	28/09/2011	-0,00097	0	0	1	0	0
911	GGRM	29/09/2011	-0,02037	0	0	0	1	0
912	GGRM	30/09/2011	0,03960	0	0	0	0	1



No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
913	GJTL	02/08/2011	-0,03200	0	1	0	0	0
914	GJTL	03/08/2011	0,04132	0	0	1	0	0
915	GJTL	04/08/2011	0,01587	0	0	0	1	0
916	GJTL	05/08/2011	-0,07031	0	0	0	0	1
917	GJTL	08/08/2011	-0,03361	1	0	0	0	0
918	GJTL	09/08/2011	-0,04348	0	1	0	0	0
919	GJTL	10/08/2011	0,04545	0	0	1	0	0
920	GJTL	11/08/2011	0,02609	0	0	0	1	0
921	GJTL	12/08/2011	0,00847	0	0	0	0	1
922	GJTL	15/08/2011	0,01681	1	0	0	0	0
923	GJTL	16/08/2011	-0,00826	0	1	0	0	0
924	GJTL	18/08/2011	0,00833	0	0	0	1	0
925	GJTL	19/08/2011	-0,04132	0	0	0	0	1
926	GJTL	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
927	GJTL	23/08/2011	0,01724	0	1	0	0	0
928	GJTL	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
929	GJTL	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
930	GJTL	26/08/2011	-0,01695	0	0	0	0	1
931	GJTL	05/09/2011	0,01724	1	0	0	0	0
932	GJTL	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
933	GJTL	07/09/2011	0,05085	0	0	1	0	0
934	GJTL	08/09/2011	0,01613	0	0	0	1	0
935	GJTL	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
936	GJTL	12/09/2011	-0,04762	1	0	0	0	0
937	GJTL	13/09/2011	-0,00833	0	1	0	0	0
938	GJTL	14/09/2011	-0,03361	0	0	1	0	0
939	GJTL	15/09/2011	-0,02609	0	0	0	1	0
940	GJTL	16/09/2011	0,02679	0	0	0	0	1
941	GJTL	19/09/2011	-0,04348	1	0	0	0	0
942	GJTL	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
943	GJTL	21/09/2011	-0,00909	0	0	1	0	0
944	GJTL	22/09/2011	-0,11009	0	0	0	1	0
945	GJTL	23/09/2011	-0,03093	0	0	0	0	1
946	GJTL	26/09/2011	-0,06383	1	0	0	0	0
947	GJTL	27/09/2011	0,10227	0	1	0	0	0
948	GJTL	28/09/2011	0,05155	0	0	1	0	0
949	GJTL	29/09/2011	0,00980	0	0	0	1	0
950	GJTL	30/09/2011	-0,03883	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
951	INCO	02/08/2011	-0,01754	0	1	0	0	0
952	INCO	03/08/2011	-0,01786	0	0	1	0	0
953	INCO	04/08/2011	-0,01212	0	0	0	1	0
954	INCO	05/08/2011	-0,06135	0	0	0	0	1
955	INCO	08/08/2011	-0,03268	1	0	0	0	0
956	INCO	09/08/2011	-0,04730	0	1	0	0	0
957	INCO	10/08/2011	0,02837	0	0	1	0	0
958	INCO	11/08/2011	0,02069	0	0	0	1	0
959	INCO	12/08/2011	0,02703	0	0	0	0	1
960	INCO	15/08/2011	0,01316	1	0	0	0	0
961	INCO	16/08/2011	0,00649	0	1	0	0	0
962	INCO	18/08/2011	0,01290	0	0	0	1	0
963	INCO	19/08/2011	-0,05732	0	0	0	0	1
964	INCO	22/08/2011	0,01351	1	0	0	0	0
965	INCO	23/08/2011	-0,00667	0	1	0	0	0
966	INCO	24/08/2011	-0,04027	0	0	1	0	0
967	INCO	25/08/2011	-0,02098	0	0	0	1	0
968	INCO	26/08/2011	0,04286	0	0	0	0	1
969	INCO	05/09/2011	0,01370	1	0	0	0	0
970	INCO	06/09/2011	0,00676	0	1	0	0	0
971	INCO	07/09/2011	0,06711	0	0	1	0	0
972	INCO	08/09/2011	0,00629	0	0	0	1	0
973	INCO	09/09/2011	-0,01875	0	0	0	0	1
974	INCO	12/09/2011	-0,03185	1	0	0	0	0
975	INCO	13/09/2011	-0,01316	0	1	0	0	0
976	INCO	14/09/2011	-0,00667	0	0	1	0	0
977	INCO	15/09/2011	-0,03356	0	0	0	1	0
978	INCO	16/09/2011	0,04167	0	0	0	0	1
979	INCO	19/09/2011	-0,02667	1	0	0	0	0
980	INCO	20/09/2011	-0,00685	0	1	0	0	0
981	INCO	21/09/2011	-0,02759	0	0	1	0	0
982	INCO	22/09/2011	-0,13475	0	0	0	1	0
983	INCO	23/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
984	INCO	26/09/2011	-0,04918	1	0	0	0	0
985	INCO	27/09/2011	0,03448	0	1	0	0	0
986	INCO	28/09/2011	-0,00833	0	0	1	0	0
987	INCO	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
988	INCO	30/09/2011	0,01681	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
989	INDF	02/08/2011	-0,01563	0	1	0	0	0
990	INDF	03/08/2011	0,02381	0	0	1	0	0
991	INDF	04/08/2011	0,00775	0	0	0	1	0
992	INDF	05/08/2011	-0,01538	0	0	0	0	1
993	INDF	08/08/2011	-0,03125	1	0	0	0	0
994	INDF	09/08/2011	-0,01613	0	1	0	0	0
995	INDF	10/08/2011	0,04098	0	0	1	0	0
996	INDF	11/08/2011	0,02362	0	0	0	1	0
997	INDF	12/08/2011	-0,00769	0	0	0	0	1
998	INDF	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
999	INDF	16/08/2011	-0,00775	0	1	0	0	0
1000	INDF	18/08/2011	0,00781	0	0	0	1	0
1001	INDF	19/08/2011	-0,05426	0	0	0	0	1
1002	INDF	22/08/2011	0,05738	1	0	0	0	0
1003	INDF	23/08/2011	0,04651	0	1	0	0	0
1004	INDF	24/08/2011	-0,04444	0	0	1	0	0
1005	INDF	25/08/2011	-0,03876	0	0	0	1	0
1006	INDF	26/08/2011	-0,01613	0	0	0	0	1
1007	INDF	05/09/2011	-0,02459	1	0	0	0	0
1008	INDF	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1009	INDF	07/09/2011	0,00840	0	0	1	0	0
1010	INDF	08/09/2011	-0,00833	0	0	0	1	0
1011	INDF	09/09/2011	-0,00840	0	0	0	0	1
1012	INDF	12/09/2011	-0,03390	1	0	0	0	0
1013	INDF	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1014	INDF	14/09/2011	-0,02632	0	0	1	0	0
1015	INDF	15/09/2011	-0,01802	0	0	0	1	0
1016	INDF	16/09/2011	0,03670	0	0	0	0	1
1017	INDF	19/09/2011	-0,04425	1	0	0	0	0
1018	INDF	20/09/2011	-0,02775	0	1	0	0	0
1019	INDF	21/09/2011	-0,04762	0	0	1	0	0
1020	INDF	22/09/2011	-0,13000	0	0	0	1	0
1021	INDF	23/09/2011	0,05747	0	0	0	0	1
1022	INDF	26/09/2011	-0,02174	1	0	0	0	0
1023	INDF	27/09/2011	0,04444	0	1	0	0	0
1024	INDF	28/09/2011	0,00532	0	0	1	0	0
1025	INDF	29/09/2011	0,02646	0	0	0	1	0
1026	INDF	30/09/2011	0,04124	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1027	INDY	02/08/2011	0,00685	0	1	0	0	0
1028	INDY	03/08/2011	-0,01361	0	0	1	0	0
1029	INDY	04/08/2011	-0,01379	0	0	0	1	0
1030	INDY	05/08/2011	-0,06993	0	0	0	0	1
1031	INDY	08/08/2011	-0,03759	1	0	0	0	0
1032	INDY	09/08/2011	-0,02344	0	1	0	0	0
1033	INDY	10/08/2011	0,04000	0	0	1	0	0
1034	INDY	11/08/2011	-0,02308	0	0	0	1	0
1035	INDY	12/08/2011	0,01575	0	0	0	0	1
1036	INDY	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1037	INDY	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1038	INDY	18/08/2011	0,00775	0	0	0	1	0
1039	INDY	19/08/2011	-0,05385	0	0	0	0	1
1040	INDY	22/08/2011	0,00813	1	0	0	0	0
1041	INDY	23/08/2011	0,03226	0	1	0	0	0
1042	INDY	24/08/2011	-0,01563	0	0	1	0	0
1043	INDY	25/08/2011	0,00794	0	0	0	0	0
1044	INDY	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1045	INDY	05/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1046	INDY	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1047	INDY	07/09/2011	0,07087	0	0	1	0	0
1048	INDY	08/09/2011	-0,01471	0	0	0	1	0
1049	INDY	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1050	INDY	12/09/2011	-0,03731	1	0	0	0	0
1051	INDY	13/09/2011	-0,05426	0	1	0	0	0
1052	INDY	14/09/2011	-0,03279	0	0	1	0	0
1053	INDY	15/09/2011	-0,02542	0	0	0	1	0
1054	INDY	16/09/2011	0,04348	0	0	0	0	1
1055	INDY	19/09/2011	-0,03333	1	0	0	0	0
1056	INDY	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1057	INDY	21/09/2011	-0,01724	0	0	1	0	0
1058	INDY	22/09/2011	-0,09649	0	0	0	1	0
1059	INDY	23/09/2011	-0,01883	0	0	0	0	1
1060	INDY	26/09/2011	-0,07071	1	0	0	0	0
1061	INDY	27/09/2011	0,04348	0	1	0	0	0
1062	INDY	28/09/2011	8,90625	0	0	1	0	0
1063	INDY	29/09/2011	-0,90326	0	0	0	1	0
1064	INDY	30/09/2011	-0,02174	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1065	INTP	02/08/2011	-0,01613	0	1	0	0	0
1066	INTP	03/08/2011	-0,03279	0	0	1	0	0
1067	INTP	04/08/2011	-0,01017	0	0	0	1	0
1068	INTP	05/08/2011	-0,05137	0	0	0	0	1
1069	INTP	08/08/2011	0,04693	1	0	0	0	0
1070	INTP	09/08/2011	-0,00690	0	1	0	0	0
1071	INTP	10/08/2011	0,02778	0	0	1	0	0
1072	INTP	11/08/2011	-0,02365	0	0	0	1	0
1073	INTP	12/08/2011	0,00346	0	0	0	0	1
1074	INTP	15/08/2011	0,05517	1	0	0	0	0
1075	INTP	16/08/2011	-0,01961	0	1	0	0	0
1076	INTP	18/08/2011	0,02667	0	0	0	1	0
1077	INTP	19/08/2011	-0,05195	0	0	0	0	1
1078	INTP	22/08/2011	0,02740	1	0	0	0	0
1079	INTP	23/08/2011	0,00333	0	1	0	0	0
1080	INTP	24/08/2011	-0,01661	0	0	1	0	0
1081	INTP	25/08/2011	-0,00338	0	0	0	1	0
1082	INTP	26/08/2011	0,03051	0	0	0	0	1
1083	INTP	05/09/2011	0,01974	1	0	0	0	0
1084	INTP	06/09/2011	0,00645	0	1	0	0	0
1085	INTP	07/09/2011	0,01923	0	0	1	0	0
1086	INTP	08/09/2011	-0,01887	0	0	0	1	0
1087	INTP	09/09/2011	-0,00962	0	0	0	0	1
1088	INTP	12/09/2011	-0,02913	1	0	0	0	0
1089	INTP	13/09/2011	-0,01333	0	1	0	0	0
1090	INTP	14/09/2011	-0,04392	0	0	1	0	0
1091	INTP	15/09/2011	-0,00353	0	0	0	1	0
1092	INTP	16/09/2011	-0,00355	0	0	0	0	1
1093	INTP	19/09/2011	-0,04982	1	0	0	0	0
1094	INTP	20/09/2011	-0,00749	0	1	0	0	0
1095	INTP	21/09/2011	-0,00377	0	0	1	0	0
1096	INTP	22/09/2011	-0,13152	0	0	0	1	0
1097	INTP	23/09/2011	0,11607	0	0	0	0	1
1098	INTP	26/09/2011	-0,04400	1	0	0	0	0
1099	INTP	27/09/2011	0,07531	0	1	0	0	0
1100	INTP	28/09/2011	0,03891	0	0	1	0	0
1101	INTP	29/09/2011	0,04120	0	0	0	1	0
1102	INTP	30/09/2011	0,00719	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1103	ISAT	02/08/2011	0,03571	0	1	0	0	0
1104	ISAT	03/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1105	ISAT	04/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1106	ISAT	05/08/2011	-0,02586	0	0	0	0	1
1107	ISAT	08/08/2011	-0,04425	1	0	0	0	0
1108	ISAT	09/08/2011	-0,03704	0	1	0	0	0
1109	ISAT	10/08/2011	0,01923	0	0	1	0	0
1110	ISAT	11/08/2011	0,04717	0	0	0	1	0
1111	ISAT	12/08/2011	-0,01802	0	0	0	0	1
1112	ISAT	15/08/2011	0,05505	1	0	0	0	0
1113	ISAT	16/08/2011	-0,05217	0	1	0	0	0
1114	ISAT	18/08/2011	0,06422	0	0	0	1	0
1115	ISAT	19/08/2011	-0,04310	0	0	0	0	1
1116	ISAT	22/08/2011	-0,02703	1	0	0	0	0
1117	ISAT	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1118	ISAT	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1119	ISAT	25/08/2011	-0,00926	0	0	0	1	0
1120	ISAT	26/08/2011	-0,01869	0	0	0	0	1
1121	ISAT	05/09/2011	0,04762	1	0	0	0	0
1122	ISAT	06/09/2011	0,05455	0	1	0	0	0
1123	ISAT	07/09/2011	0,03448	0	0	1	0	0
1124	ISAT	08/09/2011	-0,03333	0	0	0	1	0
1125	ISAT	09/09/2011	-0,01724	0	0	0	0	1
1126	ISAT	12/09/2011	-0,03509	1	0	0	0	0
1127	ISAT	13/09/2011	0,01818	0	1	0	0	0
1128	ISAT	14/09/2011	-0,02679	0	0	1	0	0
1129	ISAT	15/09/2011	0,03670	0	0	0	1	0
1130	ISAT	16/09/2011	0,02655	0	0	0	0	1
1131	ISAT	19/09/2011	-0,00862	1	0	0	0	0
1132	ISAT	20/09/2011	-0,01739	0	1	0	0	0
1133	ISAT	21/09/2011	-0,00865	0	0	1	0	0
1134	ISAT	22/09/2011	-0,03571	0	0	0	1	0
1135	ISAT	23/09/2011	0,02778	0	0	0	0	1
1136	ISAT	26/09/2011	0,00901	1	0	0	0	0
1137	ISAT	27/09/2011	-0,02727	0	1	0	0	0
1138	ISAT	28/09/2011	0,00935	0	0	1	0	0
1139	ISAT	29/09/2011	0,00926	0	0	0	1	0
1140	ISAT	30/09/2011	-0,03670	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1141	ITMG	02/08/2011	-0,00690	0	1	0	0	0
1142	ITMG	03/08/2011	-0,02778	0	0	1	0	0
1143	ITMG	04/08/2011	-0,01429	0	0	0	1	0
1144	ITMG	05/08/2011	-0,07350	0	0	0	0	1
1145	ITMG	08/08/2011	-0,01117	1	0	0	0	0
1146	ITMG	09/08/2011	-0,03277	0	1	0	0	0
1147	ITMG	10/08/2011	0,04790	0	0	1	0	0
1148	ITMG	11/08/2011	-0,02007	0	0	0	1	0
1149	ITMG	12/08/2011	0,01251	0	0	0	0	1
1150	ITMG	15/08/2011	0,04494	1	0	0	0	0
1151	ITMG	16/08/2011	-0,01935	0	1	0	0	0
1152	ITMG	18/08/2011	0,00110	0	0	0	1	0
1153	ITMG	19/08/2011	-0,04929	0	0	0	0	1
1154	ITMG	22/08/2011	-0,00922	1	0	0	0	0
1155	ITMG	23/08/2011	0,00698	0	1	0	0	0
1156	ITMG	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1157	ITMG	25/08/2011	-0,69400	0	0	0	1	0
1158	ITMG	26/08/2011	2,25660	0	0	0	0	1
1159	ITMG	05/09/2011	-0,01390	1	0	0	0	0
1160	ITMG	06/09/2011	0,03995	0	1	0	0	0
1161	ITMG	07/09/2011	0,05424	0	0	1	0	0
1162	ITMG	08/09/2011	-0,01393	0	0	0	1	0
1163	ITMG	09/09/2011	-0,00435	0	0	0	0	1
1164	ITMG	12/09/2011	-0,03057	1	0	0	0	0
1165	ITMG	13/09/2011	0,00676	0	1	0	0	0
1166	ITMG	14/09/2011	-0,01678	0	0	1	0	0
1167	ITMG	15/09/2011	-0,00683	0	0	0	1	0
1168	ITMG	16/09/2011	0,02062	0	0	0	0	1
1169	ITMG	19/09/2011	-0,00112	1	0	0	0	0
1170	ITMG	20/09/2011	0,00674	0	1	0	0	0
1171	ITMG	21/09/2011	-0,90179	0	0	1	0	0
1172	ITMG	22/09/2011	7,00682	0	0	0	1	0
1173	ITMG	23/09/2011	0,04903	0	0	0	0	1
1174	ITMG	26/09/2011	-0,04551	1	0	0	0	0
1175	ITMG	27/09/2011	0,02835	0	1	0	0	0
1176	ITMG	28/09/2011	0,01504	0	0	1	0	0
1177	ITMG	29/09/2011	-0,00741	0	0	0	1	0
1178	ITMG	30/09/2011	-0,02363	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1179	JSMR	02/08/2011	0,00629	0	1	0	0	0
1180	JSMR	03/08/2011	-0,01250	0	0	1	0	0
1181	JSMR	04/08/2011	-0,01266	0	0	0	1	0
1182	JSMR	05/08/2011	-0,01923	0	0	0	0	1
1183	JSMR	08/08/2011	0,01307	1	0	0	0	0
1184	JSMR	09/08/2011	-0,03871	0	1	0	0	0
1185	JSMR	10/08/2011	0,02685	0	0	1	0	0
1186	JSMR	11/08/2011	0,00654	0	0	0	1	0
1187	JSMR	12/08/2011	0,01299	0	0	0	0	1
1188	JSMR	15/08/2011	0,00641	1	0	0	0	0
1189	JSMR	16/08/2011	0,03185	0	1	0	0	0
1190	JSMR	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1191	JSMR	19/08/2011	-0,01852	0	0	0	0	1
1192	JSMR	22/08/2011	0,01258	1	0	0	0	0
1193	JSMR	23/08/2011	0,00621	0	1	0	0	0
1194	JSMR	24/08/2011	-0,00617	0	0	1	0	0
1195	JSMR	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1196	JSMR	26/08/2011	-0,00621	0	0	0	0	1
1197	JSMR	05/09/2011	0,02500	1	0	0	0	0
1198	JSMR	06/09/2011	0,03049	0	1	0	0	0
1199	JSMR	07/09/2011	-0,00592	0	0	1	0	0
1200	JSMR	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1201	JSMR	09/09/2011	-0,00595	0	0	0	0	1
1202	JSMR	12/09/2011	-0,05389	1	0	0	0	0
1203	JSMR	13/09/2011	0,01266	0	1	0	0	0
1204	JSMR	14/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1205	JSMR	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1206	JSMR	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1207	JSMR	19/09/2011	-0,01875	1	0	0	0	0
1208	JSMR	20/09/2011	0,00637	0	1	0	0	0
1209	JSMR	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1210	JSMR	22/09/2011	-0,09494	0	0	0	1	0
1211	JSMR	23/09/2011	0,00599	0	0	0	0	1
1212	JSMR	26/09/2011	-0,02778	1	0	0	0	0
1213	JSMR	27/09/2011	0,07857	0	1	0	0	0
1214	JSMR	28/09/2011	0,04636	0	0	1	0	0
1215	JSMR	29/09/2011	0,00633	0	0	0	1	0
1216	JSMR	30/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1



No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1217	KLBF	02/08/2011	-0,01418	0	1	0	0	0
1218	KLBF	03/08/2011	-0,02158	0	0	1	0	0
1219	KLBF	04/08/2011	-0,02206	0	0	0	1	0
1220	KLBF	05/08/2011	-0,03759	0	0	0	0	1
1221	KLBF	08/08/2011	-0,00781	1	0	0	0	0
1222	KLBF	09/08/2011	-0,06299	0	1	0	0	0
1223	KLBF	10/08/2011	0,11765	0	0	1	0	0
1224	KLBF	11/08/2011	0,03759	0	0	0	1	0
1225	KLBF	12/08/2011	-0,00725	0	0	0	0	1
1226	KLBF	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1227	KLBF	16/08/2011	-0,02190	0	1	0	0	0
1228	KLBF	18/08/2011	0,05224	0	0	0	1	0
1229	KLBF	19/08/2011	-0,02837	0	0	0	0	1
1230	KLBF	22/08/2011	-0,00730	1	0	0	0	0
1231	KLBF	23/08/2011	0,01471	0	1	0	0	0
1232	KLBF	24/08/2011	-0,01449	0	0	1	0	0
1233	KLBF	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1234	KLBF	26/08/2011	0,02206	0	0	0	0	1
1235	KLBF	05/09/2011	-0,00719	1	0	0	0	0
1236	KLBF	06/09/2011	0,02174	0	1	0	0	0
1237	KLBF	07/09/2011	0,02128	0	0	1	0	0
1238	KLBF	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1239	KLBF	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1240	KLBF	12/09/2011	0,00694	1	0	0	0	0
1241	KLBF	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1242	KLBF	14/09/2011	-0,01379	0	0	1	0	0
1243	KLBF	15/09/2011	-0,03497	0	0	0	1	0
1244	KLBF	16/09/2011	0,02899	0	0	0	0	1
1245	KLBF	19/09/2011	-0,02113	1	0	0	0	0
1246	KLBF	20/09/2011	-0,00719	0	1	0	0	0
1247	KLBF	21/09/2011	-0,01449	0	0	1	0	0
1248	KLBF	22/09/2011	-0,16912	0	0	0	1	0
1249	KLBF	23/09/2011	0,02655	0	0	0	0	1
1250	KLBF	26/09/2011	0,36207	1	0	0	0	0
1251	KLBF	27/09/2011	-0,21519	0	1	0	0	0
1252	KLBF	28/09/2011	0,04032	0	0	1	0	0
1253	KLBF	29/09/2011	0,01550	0	0	0	1	0
1254	KLBF	30/09/2011	-0,00763	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1255	LPKR	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1256	LPKR	03/08/2011	-0,02353	0	0	1	0	0
1257	LPKR	04/08/2011	-0,01205	0	0	0	1	0
1258	LPKR	05/08/2011	-0,06098	0	0	0	0	1
1259	LPKR	08/08/2011	-0,05195	1	0	0	0	0
1260	LPKR	09/08/2011	-0,01370	0	1	0	0	0
1261	LPKR	10/08/2011	0,05556	0	0	1	0	0
1262	LPKR	11/08/2011	0,02632	0	0	0	1	0
1263	LPKR	12/08/2011	0,01282	0	0	0	0	1
1264	LPKR	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1265	LPKR	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1266	LPKR	18/08/2011	0,01266	0	0	0	1	0
1267	LPKR	19/08/2011	-0,08750	0	0	0	0	1
1268	LPKR	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1269	LPKR	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1270	LPKR	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1271	LPKR	25/08/2011	0,01370	0	0	0	1	0
1272	LPKR	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1273	LPKR	05/09/2011	-0,01351	1	0	0	0	0
1274	LPKR	06/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1275	LPKR	07/09/2011	0,01370	0	0	1	0	0
1276	LPKR	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1277	LPKR	09/09/2011	0,01351	0	0	0	0	1
1278	LPKR	12/09/2011	-0,02667	1	0	0	0	0
1279	LPKR	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1280	LPKR	14/09/2011	-0,01370	0	0	1	0	0
1281	LPKR	15/09/2011	-0,02778	0	0	0	1	0
1282	LPKR	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1283	LPKR	19/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1284	LPKR	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1285	LPKR	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1286	LPKR	22/09/2011	-0,05714	0	0	0	1	0
1287	LPKR	23/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1288	LPKR	26/09/2011	-0,04545	1	0	0	0	0
1289	LPKR	27/09/2011	0,07937	0	1	0	0	0
1290	LPKR	28/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1291	LPKR	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1292	LPKR	30/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1293	LSIP	02/08/2011	0,01053	0	1	0	0	0
1294	LSIP	03/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1295	LSIP	04/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1296	LSIP	05/08/2011	-0,04167	0	0	0	0	1
1297	LSIP	08/08/2011	-0,01087	1	0	0	0	0
1298	LSIP	09/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1299	LSIP	10/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1300	LSIP	11/08/2011	0,01099	0	0	0	1	0
1301	LSIP	12/08/2011	0,01087	0	0	0	0	1
1302	LSIP	15/08/2011	0,02151	1	0	0	0	0
1303	LSIP	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1304	LSIP	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1305	LSIP	19/08/2011	-0,03158	0	0	0	0	1
1306	LSIP	22/08/2011	0,04348	1	0	0	0	0
1307	LSIP	23/08/2011	0,01042	0	1	0	0	0
1308	LSIP	24/08/2011	-0,03093	0	0	1	0	0
1309	LSIP	25/08/2011	0,02128	0	0	0	1	0
1310	LSIP	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1311	LSIP	05/09/2011	-0,02083	1	0	0	0	0
1312	LSIP	06/09/2011	-0,01064	0	1	0	0	0
1313	LSIP	07/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1314	LSIP	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1315	LSIP	09/09/2011	-0,01075	0	0	0	0	1
1316	LSIP	12/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1317	LSIP	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1318	LSIP	14/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1319	LSIP	15/09/2011	-0,04348	0	0	0	1	0
1320	LSIP	16/09/2011	0,01136	0	0	0	0	1
1321	LSIP	19/09/2011	-0,01124	1	0	0	0	0
1322	LSIP	20/09/2011	-0,02273	0	1	0	0	0
1323	LSIP	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1324	LSIP	22/09/2011	-0,10698	0	0	0	1	0
1325	LSIP	23/09/2011	0,00521	0	0	0	0	1
1326	LSIP	26/09/2011	-0,08808	1	0	0	0	0
1327	LSIP	27/09/2011	0,08523	0	1	0	0	0
1328	LSIP	28/09/2011	0,01047	0	0	1	0	0
1329	LSIP	29/09/2011	0,04922	0	0	0	1	0
1330	LSIP	30/09/2011	0,01235	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1331	MEDC	02/08/2011	0,01000	0	1	0	0	0
1332	MEDC	03/08/2011	-0,00990	0	0	1	0	0
1333	MEDC	04/08/2011	-0,01000	0	0	0	1	0
1334	MEDC	05/08/2011	-0,05051	0	0	0	0	1
1335	MEDC	08/08/2011	0,01064	1	0	0	0	0
1336	MEDC	09/08/2011	-0,02105	0	1	0	0	0
1337	MEDC	10/08/2011	0,03226	0	0	1	0	0
1338	MEDC	11/08/2011	0,04167	0	0	0	1	0
1339	MEDC	12/08/2011	0,03000	0	0	0	0	1
1340	MEDC	15/08/2011	0,00971	1	0	0	0	0
1341	MEDC	16/08/2011	-0,02885	0	1	0	0	0
1342	MEDC	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1343	MEDC	19/08/2011	-0,05941	0	0	0	0	1
1344	MEDC	22/08/2011	0,01053	1	0	0	0	0
1345	MEDC	23/08/2011	0,02083	0	1	0	0	0
1346	MEDC	24/08/2011	-0,01020	0	0	1	0	0
1347	MEDC	25/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1348	MEDC	26/08/2011	-0,02062	0	0	0	0	1
1349	MEDC	05/09/2011	-0,02105	1	0	0	0	0
1350	MEDC	06/09/2011	0,03226	0	1	0	0	0
1351	MEDC	07/09/2011	0,04167	0	0	1	0	0
1352	MEDC	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1353	MEDC	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1354	MEDC	12/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1355	MEDC	13/09/2011	0,01000	0	1	0	0	0
1356	MEDC	14/09/2011	-0,00990	0	0	1	0	0
1357	MEDC	15/09/2011	0,01000	0	0	0	1	0
1358	MEDC	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1359	MEDC	19/09/2011	-0,00990	1	0	0	0	0
1360	MEDC	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1361	MEDC	21/09/2011	-0,02000	0	0	1	0	0
1362	MEDC	22/09/2011	-0,12245	0	0	0	1	0
1363	MEDC	23/09/2011	0,01163	0	0	0	0	1
1364	MEDC	26/09/2011	-0,05747	1	0	0	0	0
1365	MEDC	27/09/2011	0,06098	0	1	0	0	0
1366	MEDC	28/09/2011	-0,01149	0	0	1	0	0
1367	MEDC	29/09/2011	-0,01163	0	0	0	1	0
1368	MEDC	30/09/2011	0,01176	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1369	PGAS	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1370	PGAS	03/08/2011	-0,04375	0	0	1	0	0
1371	PGAS	04/08/2011	-0,05882	0	0	0	1	0
1372	PGAS	05/08/2011	-0,11806	0	0	0	0	1
1373	PGAS	08/08/2011	0,03150	1	0	0	0	0
1374	PGAS	09/08/2011	-0,02290	0	1	0	0	0
1375	PGAS	10/08/2011	0,03906	0	0	1	0	0
1376	PGAS	11/08/2011	0,01504	0	0	0	1	0
1377	PGAS	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1378	PGAS	15/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1379	PGAS	16/08/2011	-0,01481	0	1	0	0	0
1380	PGAS	18/08/2011	0,03008	0	0	0	1	0
1381	PGAS	19/08/2011	-0,03650	0	0	0	0	1
1382	PGAS	22/08/2011	-0,02273	1	0	0	0	0
1383	PGAS	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1384	PGAS	24/08/2011	-0,03876	0	0	1	0	0
1385	PGAS	25/08/2011	-0,03226	0	0	0	1	0
1386	PGAS	26/08/2011	-0,01667	0	0	0	0	1
1387	PGAS	05/09/2011	-0,05932	1	0	0	0	0
1388	PGAS	06/09/2011	-0,00901	0	1	0	0	0
1389	PGAS	07/09/2011	0,06364	0	0	1	0	0
1390	PGAS	08/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1391	PGAS	09/09/2011	-0,00855	0	0	0	0	1
1392	PGAS	12/09/2011	-0,03448	1	0	0	0	0
1393	PGAS	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1394	PGAS	14/09/2011	-0,02679	0	0	1	0	0
1395	PGAS	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1396	PGAS	16/09/2011	-0,01835	0	0	0	0	1
1397	PGAS	19/09/2011	-0,03738	1	0	0	0	0
1398	PGAS	20/09/2011	0,00971	0	1	0	0	0
1399	PGAS	21/09/2011	-0,02885	0	0	1	0	0
1400	PGAS	22/09/2011	-0,12871	0	0	0	1	0
1401	PGAS	23/09/2011	0,06318	0	0	0	0	1
1402	PGAS	26/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1403	PGAS	27/09/2011	0,12766	0	1	0	0	0
1404	PGAS	28/09/2011	0,04717	0	0	1	0	0
1405	PGAS	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1406	PGAS	30/09/2011	-0,03604	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1407	PTBA	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1408	PTBA	03/08/2011	-0,00701	0	0	1	0	0
1409	PTBA	04/08/2011	-0,01882	0	0	0	1	0
1410	PTBA	05/08/2011	-0,05516	0	0	0	0	1
1411	PTBA	08/08/2011	-0,01777	1	0	0	0	0
1412	PTBA	09/08/2011	-0,07752	0	1	0	0	0
1413	PTBA	10/08/2011	0,04762	0	0	1	0	0
1414	PTBA	11/08/2011	0,00535	0	0	0	1	0
1415	PTBA	12/08/2011	0,00266	0	0	0	0	1
1416	PTBA	15/08/2011	0,01326	1	0	0	0	0
1417	PTBA	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1418	PTBA	18/08/2011	0,03141	0	0	0	1	0
1419	PTBA	19/08/2011	-0,04569	0	0	0	0	1
1420	PTBA	22/08/2011	0,02926	1	0	0	0	0
1421	PTBA	23/08/2011	0,01292	0	1	0	0	0
1422	PTBA	24/08/2011	-0,01786	0	0	1	0	0
1423	PTBA	25/08/2011	0,00260	0	0	0	1	0
1424	PTBA	26/08/2011	-0,01295	0	0	0	0	1
1425	PTBA	05/09/2011	0,00787	1	0	0	0	0
1426	PTBA	06/09/2011	0,00260	0	1	0	0	0
1427	PTBA	07/09/2011	0,01974	0	0	1	0	0
1428	PTBA	08/09/2011	0,00866	0	0	0	1	0
1429	PTBA	09/09/2011	-0,00505	0	0	0	0	1
1430	PTBA	12/09/2011	-0,02284	1	0	0	0	0
1431	PTBA	13/09/2011	-0,02338	0	1	0	0	0
1432	PTBA	14/09/2011	-0,02128	0	0	1	0	0
1433	PTBA	15/09/2011	-0,03261	0	0	0	1	0
1434	PTBA	16/09/2011	0,00843	0	0	0	0	1
1435	PTBA	19/09/2011	-0,01950	1	0	0	0	0
1436	PTBA	20/09/2011	-0,01705	0	1	0	0	0
1437	PTBA	21/09/2011	-0,01156	0	0	1	0	0
1438	PTBA	22/09/2011	-0,03772	0	0	0	1	0
1439	PTBA	23/09/2011	0,00962	0	0	0	0	1
1440	PTBA	26/09/2011	-0,06349	1	0	0	0	0
1441	PTBA	27/09/2011	0,04746	0	1	0	0	0
1442	PTBA	28/09/2011	0,04207	0	0	1	0	0
1443	PTBA	29/09/2011	0,01242	0	0	0	1	0
1444	PTBA	30/09/2011	0,03067	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1445	SMCB	02/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1446	SMCB	03/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1447	SMCB	04/08/2011	-0,02381	0	0	0	1	0
1448	SMCB	05/08/2011	-0,04390	0	0	0	0	1
1449	SMCB	08/08/2011	-0,00510	1	0	0	0	0
1450	SMCB	09/08/2011	-0,01538	0	1	0	0	0
1451	SMCB	10/08/2011	0,02083	0	0	1	0	0
1452	SMCB	11/08/2011	-0,01531	0	0	0	1	0
1453	SMCB	12/08/2011	0,02591	0	0	0	0	1
1454	SMCB	15/08/2011	0,03535	1	0	0	0	0
1455	SMCB	16/08/2011	-0,01220	0	1	0	0	0
1456	SMCB	18/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1457	SMCB	19/08/2011	-0,04691	0	0	0	0	1
1458	SMCB	22/08/2011	0,01036	1	0	0	0	0
1459	SMCB	23/08/2011	0,00513	0	1	0	0	0
1460	SMCB	24/08/2011	-0,00510	0	0	1	0	0
1461	SMCB	25/08/2011	-0,01538	0	0	0	1	0
1462	SMCB	26/08/2011	0,01042	0	0	0	0	1
1463	SMCB	05/09/2011	-0,01031	1	0	0	0	0
1464	SMCB	06/09/2011	0,01563	0	1	0	0	0
1465	SMCB	07/09/2011	0,05128	0	0	1	0	0
1466	SMCB	08/09/2011	0,02439	0	0	0	1	0
1467	SMCB	09/09/2011	-0,02381	0	0	0	0	1
1468	SMCB	12/09/2011	-0,02439	1	0	0	0	0
1469	SMCB	13/09/2011	-0,00500	0	1	0	0	0
1470	SMCB	14/09/2011	-0,00503	0	0	1	0	0
1471	SMCB	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1472	SMCB	16/09/2011	0,00505	0	0	0	0	1
1473	SMCB	19/09/2011	-0,03015	1	0	0	0	0
1474	SMCB	20/09/2011	-0,00518	0	1	0	0	0
1475	SMCB	21/09/2011	-0,02083	0	0	1	0	0
1476	SMCB	22/09/2011	-0,06383	0	0	0	1	0
1477	SMCB	23/09/2011	-0,00568	0	0	0	0	1
1478	SMCB	26/09/2011	-0,04000	1	0	0	0	0
1479	SMCB	27/09/2011	0,02976	0	1	0	0	0
1480	SMCB	28/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1481	SMCB	29/09/2011	0,00578	0	0	0	1	0
1482	SMCB	30/09/2011	0,02299	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1483	SMGR	02/08/2011	0,00532	0	1	0	0	0
1484	SMGR	03/08/2011	-0,02116	0	0	1	0	0
1485	SMGR	04/08/2011	-0,01081	0	0	0	1	0
1486	SMGR	05/08/2011	-0,02732	0	0	0	0	1
1487	SMGR	08/08/2011	0,02809	1	0	0	0	0
1488	SMGR	09/08/2011	-0,04918	0	1	0	0	0
1489	SMGR	10/08/2011	0,01724	0	0	1	0	0
1490	SMGR	11/08/2011	-0,00565	0	0	0	1	0
1491	SMGR	12/08/2011	0,00568	0	0	0	0	1
1492	SMGR	15/08/2011	0,00565	1	0	0	0	0
1493	SMGR	16/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1494	SMGR	18/08/2011	0,02247	0	0	0	1	0
1495	SMGR	19/08/2011	-0,03297	0	0	0	0	1
1496	SMGR	22/08/2011	0,02841	1	0	0	0	0
1497	SMGR	23/08/2011	0,02210	0	1	0	0	0
1498	SMGR	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1499	SMGR	25/08/2011	-0,01622	0	0	0	1	0
1500	SMGR	26/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1501	SMGR	05/09/2011	0,02747	1	0	0	0	0
1502	SMGR	06/09/2011	-0,01604	0	1	0	0	0
1503	SMGR	07/09/2011	0,01087	0	0	1	0	0
1504	SMGR	08/09/2011	-0,00538	0	0	0	1	0
1505	SMGR	09/09/2011	-0,01081	0	0	0	0	1
1506	SMGR	12/09/2011	-0,02732	1	0	0	0	0
1507	SMGR	13/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1508	SMGR	14/09/2011	-0,01685	0	0	1	0	0
1509	SMGR	15/09/2011	-0,02857	0	0	0	1	0
1510	SMGR	16/09/2011	0,02353	0	0	0	0	1
1511	SMGR	19/09/2011	-0,02299	1	0	0	0	0
1512	SMGR	20/09/2011	-0,01176	0	1	0	0	0
1513	SMGR	21/09/2011	-0,01786	0	0	1	0	0
1514	SMGR	22/09/2011	-0,00667	0	0	0	1	0
1515	SMGR	23/09/2011	0,05844	0	0	0	0	1
1516	SMGR	26/09/2011	-0,03681	1	0	0	0	0
1517	SMGR	27/09/2011	0,03185	0	1	0	0	0
1518	SMGR	28/09/2011	0,03086	0	0	1	0	0
1519	SMGR	29/09/2011	0,02395	0	0	0	1	0
1520	SMGR	30/09/2011	-0,02924	0	0	0	0	1



No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1521	TINS	02/08/2011	-0,02020	0	1	0	0	0
1522	TINS	03/08/2011	-0,02062	0	0	1	0	0
1523	TINS	04/08/2011	-0,01053	0	0	0	1	0
1524	TINS	05/08/2011	-0,10638	0	0	0	0	1
1525	TINS	08/08/2011	-0,01190	1	0	0	0	0
1526	TINS	09/08/2011	-0,04578	0	1	0	0	0
1527	TINS	10/08/2011	0,04798	0	0	1	0	0
1528	TINS	11/08/2011	0,03614	0	0	0	1	0
1529	TINS	12/08/2011	0,03488	0	0	0	0	1
1530	TINS	15/08/2011	0,04494	1	0	0	0	0
1531	TINS	16/08/2011	-0,02151	0	1	0	0	0
1532	TINS	18/08/2011	0,02198	0	0	0	1	0
1533	TINS	19/08/2011	-0,06452	0	0	0	0	1
1534	TINS	22/08/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1535	TINS	23/08/2011	0,02299	0	1	0	0	0
1536	TINS	24/08/2011	-0,02247	0	0	1	0	0
1537	TINS	25/08/2011	0,03448	0	0	0	1	0
1538	TINS	26/08/2011	-0,01111	0	0	0	0	1
1539	TINS	05/09/2011	-0,01124	1	0	0	0	0
1540	TINS	06/09/2011	0,01136	0	1	0	0	0
1541	TINS	07/09/2011	0,05618	0	0	1	0	0
1542	TINS	08/09/2011	-0,01064	0	0	0	1	0
1543	TINS	09/09/2011	-0,02151	0	0	0	0	1
1544	TINS	12/09/2011	-0,04396	1	0	0	0	0
1545	TINS	13/09/2011	0,00000	0	0	0	0	0
1546	TINS	14/09/2011	-0,02299	0	0	1	0	0
1547	TINS	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1548	TINS	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1549	TINS	19/09/2011	-0,02353	1	0	0	0	0
1550	TINS	20/09/2011	0,01205	0	1	0	0	0
1551	TINS	21/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1552	TINS	22/09/2011	-0,10952	0	0	0	1	0
1553	TINS	23/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1554	TINS	26/09/2011	-0,09091	1	0	0	0	0
1555	TINS	27/09/2011	0,06471	0	1	0	0	0
1556	TINS	28/09/2011	0,00552	0	0	1	0	0
1557	TINS	29/09/2011	-0,01648	0	0	0	1	0
1558	TINS	30/09/2011	-0,01117	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1559	TLKM	02/08/2011	0,01333	0	1	0	0	0
1560	TLKM	03/08/2011	-0,00658	0	0	1	0	0
1561	TLKM	04/08/2011	0,03311	0	0	0	1	0
1562	TLKM	05/08/2011	-0,03205	0	0	0	0	1
1563	TLKM	08/08/2011	-0,00662	1	0	0	0	0
1564	TLKM	09/08/2011	-0,04000	0	1	0	0	0
1565	TLKM	10/08/2011	-0,01389	0	0	1	0	0
1566	TLKM	11/08/2011	0,03521	0	0	0	1	0
1567	TLKM	12/08/2011	-0,00680	0	0	0	0	1
1568	TLKM	15/08/2011	-0,00685	1	0	0	0	0
1569	TLKM	16/08/2011	-0,00690	0	1	0	0	0
1570	TLKM	18/08/2011	0,03472	0	0	0	1	0
1571	TLKM	19/08/2011	-0,00671	0	0	0	0	1
1572	TLKM	22/08/2011	-0,01351	1	0	0	0	0
1573	TLKM	23/08/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1574	TLKM	24/08/2011	-0,00685	0	0	1	0	0
1575	TLKM	25/08/2011	-0,00690	0	0	0	1	0
1576	TLKM	26/08/2011	0,00694	0	0	0	0	1
1577	TLKM	05/09/2011	0,04138	1	0	0	0	0
1578	TLKM	06/09/2011	0,01325	0	1	0	0	0
1579	TLKM	07/09/2011	0,03268	0	0	1	0	0
1580	TLKM	08/09/2011	-0,03165	0	0	0	1	0
1581	TLKM	09/09/2011	-0,00654	0	0	0	0	1
1582	TLKM	12/09/2011	-0,02632	1	0	0	0	0
1583	TLKM	13/09/2011	-0,00676	0	1	0	0	0
1584	TLKM	14/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1585	TLKM	15/09/2011	0,02041	0	0	0	1	0
1586	TLKM	16/09/2011	-0,02000	0	0	0	0	1
1587	TLKM	19/09/2011	0,01361	1	0	0	0	0
1588	TLKM	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1589	TLKM	21/09/2011	0,01342	0	0	1	0	0
1590	TLKM	22/09/2011	-0,03609	0	0	0	1	0
1591	TLKM	23/09/2011	0,04348	0	0	0	0	1
1592	TLKM	26/09/2011	0,00000	1	0	0	0	0
1593	TLKM	27/09/2011	0,00694	0	1	0	0	0
1594	TLKM	28/09/2011	0,01379	0	0	1	0	0
1595	TLKM	29/09/2011	0,01361	0	0	0	1	0
1596	TLKM	30/09/2011	0,02013	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1597	UNSP	02/08/2011	0,02273	0	1	0	0	0
1598	UNSP	03/08/2011	-0,01111	0	0	1	0	0
1599	UNSP	04/08/2011	-0,02247	0	0	0	1	0
1600	UNSP	05/08/2011	-0,09195	0	0	0	0	1
1601	UNSP	08/08/2011	-0,02532	1	0	0	0	0
1602	UNSP	09/08/2011	-0,05195	0	1	0	0	0
1603	UNSP	10/08/2011	0,02740	0	0	1	0	0
1604	UNSP	11/08/2011	-0,01333	0	0	0	1	0
1605	UNSP	12/08/2011	0,02703	0	0	0	0	1
1606	UNSP	15/08/2011	0,02632	1	0	0	0	0
1607	UNSP	16/08/2011	-0,01282	0	1	0	0	0
1608	UNSP	18/08/2011	0,05195	0	0	0	1	0
1609	UNSP	19/08/2011	-0,04938	0	0	0	0	1
1610	UNSP	22/08/2011	-0,01299	1	0	0	0	0
1611	UNSP	23/08/2011	0,01316	0	1	0	0	0
1612	UNSP	24/08/2011	-0,02597	0	0	1	0	0
1613	UNSP	25/08/2011	0,01333	0	0	0	1	0
1614	UNSP	26/08/2011	-0,02632	0	0	0	0	1
1615	UNSP	05/09/2011	0,01351	1	0	0	0	0
1616	UNSP	06/09/2011	0,01333	0	1	0	0	0
1617	UNSP	07/09/2011	0,03947	0	0	1	0	0
1618	UNSP	08/09/2011	-0,01266	0	0	0	1	0
1619	UNSP	09/09/2011	-0,01282	0	0	0	0	1
1620	UNSP	12/09/2011	-0,03896	1	0	0	0	0
1621	UNSP	13/09/2011	0,01351	0	1	0	0	0
1622	UNSP	14/09/2011	-0,01333	0	0	1	0	0
1623	UNSP	15/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1624	UNSP	16/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1625	UNSP	19/09/2011	-0,04054	1	0	0	0	0
1626	UNSP	20/09/2011	0,01408	0	1	0	0	0
1627	UNSP	21/09/2011	-0,01289	0	0	1	0	0
1628	UNSP	22/09/2011	-0,12676	0	0	0	1	0
1629	UNSP	23/09/2011	-0,01513	0	0	0	0	1
1630	UNSP	26/09/2011	-0,09836	1	0	0	0	0
1631	UNSP	27/09/2011	0,09091	0	1	0	0	0
1632	UNSP	28/09/2011	-0,03333	0	0	1	0	0
1633	UNSP	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1634	UNSP	30/09/2011	-0,01724	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1635	UNTR	02/08/2011	-0,03811	0	1	0	0	0
1636	UNTR	03/08/2011	-0,01509	0	0	1	0	0
1637	UNTR	04/08/2011	-0,03065	0	0	0	1	0
1638	UNTR	05/08/2011	-0,03953	0	0	0	0	1
1639	UNTR	08/08/2011	-0,01440	1	0	0	0	0
1640	UNTR	09/08/2011	-0,03132	0	1	0	0	0
1641	UNTR	10/08/2011	0,05172	0	0	1	0	0
1642	UNTR	11/08/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1643	UNTR	12/08/2011	-0,01230	0	0	0	0	1
1644	UNTR	15/08/2011	0,02282	1	0	0	0	0
1645	UNTR	16/08/2011	-0,00406	0	1	0	0	0
1646	UNTR	18/08/2011	0,02240	0	0	0	1	0
1647	UNTR	19/08/2011	-0,06375	0	0	0	0	1
1648	UNTR	22/08/2011	-0,00426	1	0	0	0	0
1649	UNTR	23/08/2011	0,02350	0	1	0	0	0
1650	UNTR	24/08/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1651	UNTR	25/08/2011	0,00209	0	0	0	1	0
1652	UNTR	26/08/2011	-0,01667	0	0	0	0	1
1653	UNTR	05/09/2011	0,03390	1	0	0	0	0
1654	UNTR	06/09/2011	-0,00410	0	1	0	0	0
1655	UNTR	07/09/2011	0,01440	0	0	1	0	0
1656	UNTR	08/09/2011	0,01014	0	0	0	1	0
1657	UNTR	09/09/2011	0,01606	0	0	0	0	1
1658	UNTR	12/09/2011	-0,03953	1	0	0	0	0
1659	UNTR	13/09/2011	-0,02881	0	0	0	0	0
1660	UNTR	14/09/2011	-0,02119	0	0	1	0	0
1661	UNTR	15/09/2011	-0,00866	0	0	0	1	0
1662	UNTR	16/09/2011	0,02620	0	0	0	0	1
1663	UNTR	19/09/2011	-0,01702	1	0	0	0	0
1664	UNTR	20/09/2011	-0,00433	0	1	0	0	0
1665	UNTR	21/09/2011	-0,03696	0	0	1	0	0
1666	UNTR	22/09/2011	-0,09481	0	0	0	1	0
1667	UNTR	23/09/2011	-0,01496	0	0	0	0	1
1668	UNTR	26/09/2011	-0,00253	1	0	0	0	0
1669	UNTR	27/09/2011	0,07107	0	1	0	0	0
1670	UNTR	28/09/2011	0,04028	0	0	1	0	0
1671	UNTR	29/09/2011	0,00000	0	0	0	1	0
1672	UNTR	30/09/2011	0,00228	0	0	0	0	1

No	Perusahaan	Tanggal	Return Y	Senin X1	Selasa X2	Rabu X3	Kamis X4	Jumat X5
1673	UNVR	02/08/2011	0,00629	0	1	0	0	0
1674	UNVR	03/08/2011	0,00625	0	0	1	0	0
1675	UNVR	04/08/2011	0,05590	0	0	0	1	0
1676	UNVR	05/08/2011	-0,04412	0	0	0	0	1
1677	UNVR	08/08/2011	-0,01538	1	0	0	0	0
1678	UNVR	09/08/2011	-0,06250	0	1	0	0	0
1679	UNVR	10/08/2011	0,05333	0	0	1	0	0
1680	UNVR	11/08/2011	0,03797	0	0	0	1	0
1681	UNVR	12/08/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1682	UNVR	15/08/2011	0,02134	1	0	0	0	0
1683	UNVR	16/08/2011	0,00299	0	1	0	0	0
1684	UNVR	18/08/2011	0,03274	0	0	0	1	0
1685	UNVR	19/08/2011	-0,04611	0	0	0	0	1
1686	UNVR	22/08/2011	2,72508	1	0	0	0	0
1687	UNVR	23/08/2011	-0,72749	0	1	0	0	0
1688	UNVR	24/08/2011	-0,02083	0	0	1	0	0
1689	UNVR	25/08/2011	-0,01824	0	0	0	1	0
1690	UNVR	26/08/2011	0,04644	0	0	0	0	1
1691	UNVR	05/09/2011	-0,00888	1	0	0	0	0
1692	UNVR	06/09/2011	0,01493	0	1	0	0	0
1693	UNVR	07/09/2011	0,02353	0	0	1	0	0
1694	UNVR	08/09/2011	0,00862	0	0	0	1	0
1695	UNVR	09/09/2011	0,00000	0	0	0	0	1
1696	UNVR	12/09/2011	-0,03134	1	0	0	0	0
1697	UNVR	13/09/2011	0,00294	0	1	0	0	0
1698	UNVR	14/09/2011	0,00293	0	0	1	0	0
1699	UNVR	15/09/2011	-0,02339	0	0	0	1	0
1700	UNVR	16/09/2011	0,00898	0	0	0	0	1
1701	UNVR	19/09/2011	-0,04748	1	0	0	0	0
1702	UNVR	20/09/2011	0,00000	0	1	0	0	0
1703	UNVR	21/09/2011	-0,01558	0	0	1	0	0
1704	UNVR	22/09/2011	-0,05063	0	0	0	1	0
1705	UNVR	23/09/2011	0,02333	0	0	0	0	1
1706	UNVR	26/09/2011	-0,00977	1	0	0	0	0
1707	UNVR	27/09/2011	0,02632	0	1	0	0	0
1708	UNVR	28/09/2011	0,00000	0	0	1	0	0
1709	UNVR	29/09/2011	0,00641	0	0	0	1	0
1710	UNVR	30/09/2011	0,05096	0	0	0	0	1

Lampiran 5. Nilai Rata-rata *Return* Saham Harian

No	Perusahaan	Senin	Selasa	Rabu	Kamis	Jumat
1	AALI	-0,0108	-0,0029	-0,0542	0,0780	-0,0115
2	ADRO	-0,0235	0,0021	0,0140	-0,0175	-0,0271
3	ANTM	-0,0175	-0,0010	-0,0014	-0,0141	-0,0038
4	ASII	0,0004	0,0416	-0,0221	-0,0070	-0,0189
5	ASRI	-0,0082	0,0008	0,0080	-0,0057	-0,0085
6	BBCA	-0,0114	0,0087	-0,0052	-0,0071	0,0013
7	BBKP	-0,0211	0,0014	-0,0036	-0,0158	-0,0143
8	BBNI	-0,0079	-0,0048	0,0043	-0,0183	0,0033
9	BBRI	-0,0182	0,0075	0,0037	-0,0104	-0,0070
10	BBTN	-0,0187	-0,0014	0,0009	-0,0202	-0,0034
11	BDMN	-0,0118	-0,0040	0,0095	-0,0126	-0,0001
12	BJBR	-0,0131	0,0063	-0,0017	-0,0165	-0,0138
13	BMRI	-0,0160	0,0035	0,0021	-0,0132	-0,0050
14	BNBR	-0,0195	0,0027	-0,0044	-0,0025	-0,0179
15	BRAU	-0,0087	0,0029	0,0061	-0,0179	-0,0087
16	BSDE	-0,0268	0,0022	0,0058	0,0027	-0,0094
17	BTEL	-0,0023	-0,0086	0,0000	0,0254	-0,0205
18	BUMI	-0,0304	0,0082	-0,0011	-0,0275	-0,0081
19	CPIN	-0,0203	0,0330	0,0115	-0,0254	-0,0068
20	DOID	-0,0217	0,0108	0,0093	-0,0063	-0,0284
21	ELSA	-0,0113	-0,0037	0,0028	-0,0215	-0,0118
22	ELTY	-0,0227	0,0066	-0,0019	-0,0196	-0,0177
23	ENRG	-0,0287	0,0063	-0,0099	-0,0264	-0,0270
24	GGRM	-0,0107	0,0081	0,0010	-0,0012	0,0020
25	GJTL	-0,0221	0,0034	0,0209	-0,0075	-0,0204
26	INCO	-0,0143	-0,0055	-0,0007	-0,0202	-0,0011
27	INDF	-0,0140	0,0030	-0,0057	-0,0162	0,0042
28	INDY	-0,0244	0,0006	1,2768	-0,1326	-0,0156
29	INTP	0,0038	0,0027	-0,0016	-0,0179	0,0051
30	ISAT	-0,0030	-0,0032	0,0039	0,0099	-0,0132
31	ITMG	-0,0095	0,0037	-0,1185	0,8814	0,2735
32	JSMR	-0,0062	0,0167	0,0069	-0,0118	-0,0037
33	KLBF	0,0465	-0,0356	0,0164	-0,0151	-0,0004
34	LPKR	-0,0197	0,0082	0,0046	-0,0055	-0,0153
35	LSIP	-0,0094	0,0071	0,0029	-0,0086	-0,0055
36	MEDC	-0,0082	0,0105	0,0018	-0,0116	-0,0096
37	PGAS	-0,0175	0,0113	0,0017	-0,0218	-0,0207
38	PTBA	-0,0105	-0,0069	0,0074	-0,0098	-0,0084
39	SMCB	-0,0092	0,0016	0,0059	-0,0110	-0,0070
40	SMGR	0,0004	-0,0022	0,0004	-0,0109	-0,0016
41	TINS	-0,0195	0,0030	0,0062	-0,0068	-0,0225
42	TLKM	0,0002	-0,0025	0,0047	0,0016	-0,0002
43	UNSP	-0,0252	0,0129	-0,0044	-0,0137	-0,0234
44	UNTR	-0,0030	-0,0020	0,0047	-0,0124	-0,0128
45	UNVR	0,3762	-0,0921	0,0071	0,0062	0,0049
	Minimal	-0,0304	-0,0921	-0,1185	-0,1326	-0,0284
	Maksimal	0,3762	0,0416	1,2768	0,8814	0,2735
	Jumlah	-0,1700	0,0631	1,2093	0,3649	-0,1570
	Data (n)	45	45	45	45	45
	Rata-rata	-0,0038	0,0014	0,0269	0,0081	-0,0035
	S. Deviasi	0,0592	0,0179	0,1917	0,1354	0,0432
	Rata-rata Keseluruhan					0,0058

Lampiran 6. Uji Multikolinieritas

Coefficients<sup>a,b</sup>

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics	
		B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF
1	Hari Senin	-.004	.019	-.005	-.204	.839	1.000	1.000
	Hari Selasa	.001	.017	.002	.081	.936	1.000	1.000
	Hari Rabu	.044	.019	.058	2.398	.017	1.000	1.000
	Hari Kamis	.004	.017	.006	.234	.815	1.000	1.000
	Hari Jumat	-.003	.017	-.005	-.201	.841	1.000	1.000

a. Dependent Variable: Return

b. Linear Regression through the Origin

### Lampiran 7. Uji Heteroskedastisitas

Coefficients<sup>a</sup>

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
		B	Std. Error	Beta		
1	(Constant)	.057	.017		3.353	.001
	Hari Senin	-.023	.025	-.028	-.925	.355
	Hari Selasa	-.032	.024	-.040	-1.317	.188
	Hari Rabu	.034	.025	.041	1.374	.170
	Hari Jumat	-.025	.024	-.032	-1.046	.296

a. Dependent Variable: abres

### Lampiran 8. Uji Autokorelasi

Model Summary<sup>a,b</sup>

Model	R	R Square <sup>b</sup>	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.059 <sup>a</sup>	.003	.001	.32899	2.244

a. Predictors: Hari Jumat, Hari Kamis, Hari Rabu, Hari Selasa, Hari Senin

b. For regression through the origin (the no-intercept model), R Square measures the proportion of the variability in the dependent variable about the origin explained by regression. This CANNOT be compared to R Square for models which include an intercept.

c. Dependent Variable: Return

d. Linear Regression through the Origin

Lampiran 9. Uji Regresi Linier Berganda

**Regression**

**Variables Entered/Removed<sup>a,c</sup>**

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	Hari Jumat, Hari Kamis, Hari Rabu, Hari Selasa, Hari Senin <sup>a</sup>		. Enter

a. All requested variables entered.

b. Dependent Variable: Return

c. Linear Regression through the Origin

**Model Summary<sup>a,d</sup>**

Model	R	R Square <sup>b</sup>	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.059 <sup>a</sup>	.003	.001	.32899	2.244

a. Predictors: Hari Jumat, Hari Kamis, Hari Rabu, Hari Selasa, Hari Senin

b. For regression through the origin (the no-intercept model), R Square measures the proportion of the variability in the dependent variable about the origin explained by regression. This CANNOT be compared to R Square for models which include an intercept.

c. Dependent Variable: Return

d. Linear Regression through the Origin

**ANOVA<sup>a,d</sup>**

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	.638	5	.128	1.179	.317 <sup>a</sup>
	Residual	184.535	1705	.108		
	Total	185.172 <sup>b</sup>	1710			

a. Predictors: Hari Jumat, Hari Kamis, Hari Rabu, Hari Selasa, Hari Senin

b. This total sum of squares is not corrected for the constant because the constant is zero for regression through the origin.

c. Dependent Variable: Return

d. Linear Regression through the Origin



**Coefficients<sup>a,b</sup>**

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics	
		B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF
1	Hari Senin	-.004	.019	-.005	-.204	.839	1.000	1.000
	Hari Selasa	.001	.017	.002	.081	.936	1.000	1.000
	Hari Rabu	.044	.019	.058	2.398	.017	1.000	1.000
	Hari Kamis	.004	.017	.006	.234	.815	1.000	1.000
	Hari Jumat	-.003	.017	-.005	-.201	.841	1.000	1.000

a. Dependent Variable: Return

b. Linear Regression through the Origin

Lampiran 10. Uji t Satu Sampel (*one sample t test*)

**T-Test**

**One-Sample Statistics**

	N	Mean	Std. Deviation	Std. Error Mean
Return	225	.0085	.12026	.00802

**One-Sample Test**

Test Value = 0						
95% Confidence Interval of the Difference						
	t	df	Sig. (2-tailed)	Mean Difference	Lower	Upper
Return	1.064	224	.288	.00853	-.0073	.0243

UNIVERSITAS TERBUKA