

Dampak peristiwa right issue terhadap return saham di Bursa Efek Jakarta periode 1997-2000 (Event studi)

Adi Waskito, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20185099&lokasi=lokal>

Abstrak

Skripsi ini merupakan penelitian terhadap dampak peristiwa right issue terhadap return saham. Penelitian ini menguji hipotesis pasar efisien bentuk setengah kuat pada peristiwa right issue pada sampel saham-saham liquid yang tercatat di Bursa Efek Jakarta periode 1997-2000 dengan metodologi event study. Pada penelitian ini ditemukan bahwa respon pasar terhadap peristiwa right issue adalah negatif dan pasar Bursa Efek Jakarta belum efisien bentuk setengah kuat pada periode 1997-2000 untuk peristiwa right issue. Hal ini dapat dibuktikan dengan adanya penolakan hipotesis tentang keberadaan abnormal return pada periode event yang berarti bahwa event mempengaruhi secara signifikan perilaku dan return saham.