

Analisis pengaruh berita inflasi terhadap tingkat pengembalian saham pada sektor industri dasar dan bahan kimia periode 2008-September 2012 = Analysis of effect of inflation news on stock returns in basic industry and chemicals sector period 2008-September 2012

Sidabutar, Misnilawaty, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20332331&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Skripsi ini meneliti mengenai pengaruh unexpected inflation terhadap tingkat pengembalian saham dengan menggunakan unexpected trade balance sebagai variabel kontrol. Tingkat pengembalian saham dihitung dengan menggunakan data intraday untuk melihat tingkat pengembalian pada menit ke-1, 5, 10, 15, 20, 25, 30, 35, 40, 45, 50, 55, 60 dan akhir perdagangan setelah pengumuman. Data berupa data panel yang meliputi 29 perusahaan dan diolah dengan menggunakan model regresi. Hasil yang diperoleh adalah bahwa unexpected inflation berpengaruh tidak signifikan pada tingkat pengembalian menit ke-5, 10, 15, 20, 25, 30 dan akhir perdagangan serta berpengaruh signifikan pada tingkat pengembalian menit ke-35, 40, 50, 55 dan 60.

ABSTRACT

This thesis examines the influence of unexpected inflation on stock returns using unexpected trade balance as a control variable. The stock returns are calculated by using intraday data to see returns at minute 1, 5, 10, 15, 20, 25, 30, 35, 40, 45, 50, 55, 60 and late trading after the announcement. Panel data covering 29 companies and processed using regression models. The finding is that the effect of unexpected inflation is not significant on stock return on the 5th minute, 10, 15, 20, 25, 30 late trading but is significant on stock return on the 35th minute, 40, 50, 55 and 60.