

Forecasting small stock premium evidence and application in Indonesia = Forecasting small stock premium evidence and application in indonesia / Dhia Izza Nabila Saad

Dhia Izza Nabila Saad, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20412816&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK
Studi ini mencoba menggali lebih dalam kedalam salah satu faktor dari model Fama-French three factor model, yakni faktor size effect. Studi ini sekali lagi membuktikan keberadaan dari size effect pada periode penelitian 10 tahun dengan horizon bulanan. Studi ini juga mencoba menggali lebih dalam, faktor-faktor apa sajakah yang sesungguhnya mempengaruhi size effect. Faktor-faktor yang potensial pada umumnya berkaitan erat dengan indikator makroekonomi dan anomali-anomali lainnya. Studi ini mencoba menganalisa, variabel manakah yang akan memengaruhi size effect bulanan di Indonesia.

ABSTRACT
This study explores deeper into one of Fama and French's factor from the three factor model, which is the size effect. This study proves again the presence of size effect for a 10 year period in a monthly time horizon, and tries to dig deeper into what factors actually creates the size effect. The potential factors are closely related to macroeconomic indicators as well as other anomalies that affects returns. This study tries to analyze, which of these variables will affect the monthly size effect in Indonesia.