

Analisis Pengaruh Imbal Hasil Saham Periode Sebelumnya, Volume Perdagangan saham, risiko, asimetri informasi dan struktur modal terhadap imbal hasil saham = The impact of past period stock return, trading volume, risk, information asymmetry and capital structure on stock return

Dian Permata Sari, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20446263&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini menganalisis pengaruh imbal hasil saham periode sebelumnya, risiko, volume perdagangan saham, asimetri informasi dan struktur modal terhadap imbal hasil saham perusahaan. Tesis ini menggunakan purposive sampling method dalam pemilihan sampel dengan berdasarkan beberapa kriteria tertentu. Sampel yang memenuhi kriteria sebanyak 88 perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode 2012-2014. Data dikumpulkan menggunakan teknik data sekunder dan uji hipotesis menggunakan metode regresi data panel dengan model efek tetap untuk mengetahui apakah variabel independen berpengaruh terhadap variabel dependen. Hasil yang diperoleh dari penelitian ini adalah volume perdagangan saham dan risiko berpengaruh positif terhadap imbal hasil saham, sedangkan imbal hasil saham periode sebelumnya dan asimetri informasi berpengaruh negatif terhadap imbal hasil saham. Hasil penelitian juga menyimpulkan bahwa struktur modal tidak berpengaruh terhadap imbal hasil saham.

.....

The purpose of this thesis is to examine the impact between past period stock return, trading volume, risk, information asymmetry and capital structure on stock return. This thesis uses purposive sampling method, which is based on certain criteria. The eligible samples for this study are 8 manufacture companies that are listed in Indonesian Stock Exchange of the period 2012 until 2014. The data are collected by secondary data technique and hypothesis test uses panel data regression with fixed effect model, in order to see whether or not the independent variables influence the dependent variable. The results of this thesis indicate that trading volume and risk have positive influence on stock return, meanwhile past period stock return and information asymmetry have negative influence on stock return. Furthermore, this thesis figures out that capital structure does not have influence on the stock return.