

Pengaruh risiko idiosinkratik dan likuiditas terhadap imbal hasil saham dengan perdagangan saham yang tinggi: analisis pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2012-2016 = The returns idiosyncratic risk and liquidity relationship in high frequency trading: analysis of companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period 2012-2016

Agung Wibowo Saputro, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20458275&lokasi=lokal>

---

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh risiko idiosinkratik dan likuiditas terhadap imbal hasil saham yang memiliki frekuensi perdagangan tinggi. Penelitian dilakukan pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode 2012 sampai dengan 2016. Pengujian dilakukan dengan regresi panel data Common Effect Model atau Pooled Least Square PLS. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa risiko idiosinkratik dan likuiditas berpengaruh signifikan negatif terhadap imbal hasil saham.

*This research is aimed to analyze the relationship of idiosyncratic risk and liquidity to stock returns with high frequency trading. Sample in this research is company that listed in Indonesia Stock Exchange within 2012 ndash 2016. The test were conducted with Pooled Least Square PLS. The result of this research found that both of idiosyncratic risk and liquidity has significant influence to stock returns with high frequency trading.*