

## Pengaruh kepemilikan asing terhadap volatilitas imbal hasil saham perusahaan di Indonesia periode 2005-2015 = Analysis of foreign investment impact on stock return volatility evidence from Indonesian company period 2005 2015

Danar Anasmoro, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20466795&lokasi=lokal>

---

### Abstrak

Penelitian ini memiliki tujuan untuk menganalisis pengaruh kepemilikan asing terhadap volatilitas imbal hasil yang dihitung dengan menggunakan dua metode penghitungan variabilitas imbal hasil pada perusahaan non-keuangan di Indonesia periode 2005-2015. Penghitungan volatilitas imbal hasil tersebut dihitung dengan menggunakan metode rerata imbal hasil tahunan dan standar deviasi saham tahunan. Teknik estimasi yang dimodelkan pada penelitian ini adalah fixed effect model dan random effect model. Hasil penelitian menunjukkan kepemilikan asing mampu menurunkan volatilitas imbal hasil saham di Indonesia menggunakan penghitungan volatilitas standar deviasi, namun meningkatkan volatilitas imbal hasil saham pada penghitungan volatilitas menggunakan rerata.

.....This research has a main objective to analyze the impact of Foreign Investment on stock return volatility in Indonesian non financial company. Measurement used to calculate volatility or variability are volatility using yearly average stock return and yearly standar deviation of a stock. This research suggests that volatility using yearly average stock return increased as Foreign Investment rise, but decreased as foreign investment rise when volatility stock calculated using yearly standard deviation of a stock.