

Analisis pengaruh illikuiditas, beta risiko sistematis, ukuran perusahaan, dan dividen yield terhadap return saham pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2006-2015 = The analysis of illiquidity, beta systematic risk, firm size, and dividend yield effect on firm stock return that listed at Indonesia stock exchange during 2006-2015

Muhammad Hady Wibowo, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20445238&lokasi=lokal>

---

Abstrak

**ABSTRAK**

Likuiditas adalah salah satu faktor yang harus diperhatikan saat berinvestasi. Penelitian ini memiliki tujuan untuk mengetahui pengaruh illikuiditas saham yang diestimasi dari tahun lalu dengan return bulanan periode 2006-2015 di Bursa Efek Indonesia. Beberapa penelitian empiris sebelumnya menemukan adanya hubungan positif signifikan antara illikuiditas dan return saham. Dalam penelitian pasar modal Indonesia dengan memasukkan variabel beta, ukuran perusahaan, dan dividend yield ditemukan hubungan yang positif dan signifikan antara illikuiditas saham yang diestimasi dari bulan yang sama pada tahun sebelumnya.

---

**ABSTRACT**

Liquidity is one of the factors that must be considered when investing. The purpose of this research is to know the effect of stock illiquidity estimated from last year to monthly stock returns in the period 2006 2015 in Indonesia Stock Exchange. Some previous empirical studies found a significant positive relationship between illiquidity and stock return. In Indonesia capital market research by including beta, firm size, and dividend yield shows a positive and significant relationship between stock illiquidity estimated from the same month in the previous year.