

Pengaruh order imbalance terhadap imbal hasil dan volatilitas harga saham teraktif berdasarkan volume perdagangan di Bursa Efek Indonesia kuartal kedua (April-Juni) tahun 2011 = The order imbalance effect's on return and price volatility of the most active stocks based on trading volume in Indonesian Stock Exchange 2nd Quarter (April-June) 2011

Kamal Nurul Iswandi, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20321508&lokasi=lokal>

Abstrak

Skripsi ini membahas pengaruh order imbalance terhadap imbal hasil dan volatilitas harga saham teraktif berdasarkan volume perdagangan di Bursa Efek Indonesia. Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisis pengaruh order imbalance terhadap imbal hasil dan volatilitas. Pendekatan yang digunakan adalah pendekatan kuantitatif dengan menggunakan teknik purposive sampling pada saham teraktif berdasarkan volume perdagangan di Bursa Efek Indonesia selama kuartal kedua (April-Juni) Tahun 2011. Penelitian ini menggunakan data time series dengan model Mixed Multiple Linear Regression (MMLR). Hasil penelitian menunjukkan bahwa order imbalance memiliki pengaruh positif yang signifikan terhadap imbal hasil dan volatilitas harga saham.

.....

The focus of this study is the order imbalance effect's on return and price volatility of the most active stocks based on trading volume in Indonesian Stock Exchange. The purpose of this study is to analyze the order imbalance effect's on return and volatility. This research is quantitative explanative with purposive sampling technique on the most active stocks based on trading volume in Indonesian Stock Exchange 2nd quarter (April-June) 2011. This research employs time series data with Mixed Multiple Linear Regression Model (MMLR). The results showed order imbalance has positive significant effect on return and stock price volatility.