

Analisis Pengaruh Information Days Terhadap Return: Studi Perusahaan yang Terdaftar pada KOMPAS100 Tahun 2015-2019 = Analysis the Effect of Information Days on Return: A Study of Companies Listed on the KOMPAS100 Index from 2015-2019

Afif Muhammad Ramadhan Sudarmin, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920518104&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini memiliki tujuan untuk menganalisis pengaruh information days terhadap anomaly return pada perusahaan yang terdapat di indeks KOMPAS100. Untuk mekanisme return yang digunakan pada penelitian ini adalah return harian perusahaan. Kemudian, untuk mengukur tingkat return pada information days menggunakan tingkat net. Dalam penelitian ini, memiliki variabel dependen return dan variabel independen net, Eday, dan Nday. Penelitian ini menggunakan sampel perusahaan perusahaan yang terdaftar secara terus menerus pada indeks KOMPAS100 periode 2015 hingga 2019 dengan teknik penarikan sampel purposive sampling. Jenis data yang digunakan merupakan data panel yang terdiri dari data time series dan cross section. Penelitian ini, memiliki satu model. Hasil pada penelitian ini menunjukkan bahwa terdapat pengaruh yang signifikan antara variabel return terhadap variabel information days dengan koefisien hasil penelitian menunjukkan return tujuh kali lebih rendah pada saat perusahaan menerbitkan berita perusahaan. Sedangkan tingkat return lebih rendah empat kali lebih rendah pada saat perusahaan menerbitkan laporan keuangan.

.....The purpose of this research is to analyze the effect of information days on anomaly returns for companies listed on the KOMPAS100 index. The mechanism of return used in this research is daily company return. Furthermore, to measure the level of return on information days, the net level is used. In this research, the dependent variable is return and the independent variables are net, Eday, and Nday. The research sample consists of continuously listed companies on the KOMPAS100 index from 2015 to 2019, and the sample was drawn using purposive sampling technique. The data used in this research is panel data, which consists of time series and cross-sectional data. This research employs one model. The results of this research indicate that there is a significant effect between the return variable and the information days variable, with the research coefficient showing that return is seven times lower during the release of company news. Additionally, the level of return is four times lower during the release of financial statements.