

المستخلص

أحمد بختير . 2014. الرسالة. الموضوع : " تحليل الاختلافات الشاذة العودية وحجم التداول آخر قبل وبعد إعلان بنك الاحتياطي الفيدرالي التحفيز 19 سبتمبر 2013 (دراسة حالة في شركة LQ 45 في البورصة)

المشرف : الدكتورة. أجوس سوسيتو، MM

الكلمات الرئيسية : عودة غير طبيعي ، حجم التداول آخر

كل حدث الأحداث سواء على الصعيد الاقتصادي والسياسي يكون لها تأثير على محتوى المعلومات من أسعار الأسهم. سوف الأحداث الاقتصادية يكون لها تأثير أكبر من التركيز على الأحداث السياسية . واحدة من الأحداث الاقتصادية التي تحتوي على المعلومات التي تؤثر على حركة IDX الأسهم هو إعلان مجلس الاحتياطي الفيدرالي التحفيز 19 سبتمبر 2013 . الغرض من هذه الدراسة هو التحقيق في رد فعل السوق على الأحداث إعلان التحفيز لمجلس الاحتياطي الفيدرالي وتظهر مع عودة غير طبيعي و حجم التداول آخر على شركة LQ 45.

يستخدم هذه الدراسة البيانات الثانوية باستخدام عينة من 45 شركة تابعة ل مجموعة LQ 45. مستخدم نماذج لحساب العائد الفعلي هو المعدل السوق النموذجي. في حين أن أداة التحليل المستخدمة هي اختبار من الحياة الطبيعية ، واستخدمت واحدة عينة اختبار t ، و مقترن عينة اختبار t لتسجيل البيانات لديها التوزيع العادي.

بناء على نتائج اختبار الفرضيات باستخدام عينة واحدة اختبار t ، وجدت الدراسة أن الأحداث إعلان التحفيز لمجلس الاحتياطي الفيدرالي من 19 سبتمبر 2014 تأثير على سوق الأسهم مع عودة غير طبيعية وأشارت والتجارة النشاط حجم كبير في أيام معينة خلال فترة المراقبة . في حين أن نتائج الفرضية الثانية اختبار باستخدام عينة إقران اختبار t ضد متوسط العائد غير طبيعي و التداول فترات النشاط الصوت قبل و بعد وقوع الحدث وأظهرت تغيرا كبيرا فقط في العوائد غير طبيعي ، في حين أن النشاط حجم التداول لم تكشف عن أي اختلاف في متوسط ما قبل و بعد الأحداث الهامة . نتائج هذه الدراسة تشير إلى أنه يحتوي على المعلومات التي يتم استيعابها من قبل المشاركين في السوق التي تؤثر على قرارات الاستثمار في أيام معينة خلال فترة المراقبة.