

Analisis pengaruh karakteristik obligasi terhadap return obligasi

Frilasari, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=124714&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk melihat apakah karakteristik dari obligasi yaitu yield to maturity, duration, dan rating dapat mempengaruhi tingkat return dari obligasi. Penelitian ini mengambil sampel berjumlah 43 obligasi yang terdaftar selama periode Desember 2003 sampai Desember 2007. Pengolahan data menggunakan dengan data panel dan pendekatan fixed effect model.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa yield to maturity, dan duration mempunyai pengaruh yang signifikan dengan return obligasi. Sementara variabel rating tidak mempunyai pengaruh yang signifikan.