

Estimasi risk premium faktor harga minyak dan jumlah uang beredar menggunakan arbitrage pricing theory

Rosalina Megawati, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=128143&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian karya akhir ini bertujuan untuk menerapkan model Arbitrage Pricing Theory (APT) guna memprediksi (sensitivitas return saham) faktor kurs, harga minyak, dan jumlah uang beredar serta bertujuan untuk memprediksi λ(risk premium) faktor kurs, harga minyak, dan jumlah uang beredar. Sampel dalam penelitian ini terdiri dari 100 saham yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia yang diambil secara random selama periode 1 Januari - 31 Desember 2007.

<hr>Purpose of this final paper is to apply Arbitrage Pricing Theory (APT) model to estimate beta's of USD, oil price, money supply and to apply Arbitrage Pricing Theory (APT) model to estimate risk premium's of USD, oil price, and money supply. This final paper uses a random sampling of 100 stocks listed at the IDX during the period of January 2003 until December 2007.