

Analisis Probability of Default dengan Metode Merton pada Perusahaan LQ45

Heriansjah, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=136200&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Tesis ini merupakan suatu studi kasus untuk menganalisis probability of default/peluang gagal bayar pada perusahaan di Indonesia. Penelitian berdasarkan laporan keuangan perusahaan LQ45. Selain melihat menganalisis secara kualitatif melalui pengukuran peluang gagal bayar. Aspek strategi perusahaan juga ditinjau untuk melihat aspek kuantitatif apakah ada aksi korporasi yang menyebabkan perubahan pada laporan keuangan perusahaan. Dari hasil studi ini disimpulkan bahwa peluang gagal bayar merton memberikan sinyal yang kuat terhadap kegagalan bayar perusahaan.

ABSTRACT

This thesis is to study cases to analysis probability of default for Indonesia companies. Studying is focusing on financial report for company that listed as LQ45. Beside of reviewing qualitative perspective by measuring probability of default, corporate strategy is also being reviewed to overview if there are corporate action that generate changes on financial reporting. This study concludes that Merton probability of default result strong signal for default event.