

Analisis pengaruh kepemilikan asing pada Surat Berharga Negara dan Sertifikat Bank Indonesia terhadap pergerakan return nilai tukar rupiah terhadap US dolar dengan metode arch carch (1,1) = Analysis of impact of foreign ownership in Indonesia's Government Security (Surat Berharga Negara) and Bank Indonesia Certificates (Sertificat Bank Indonesia) to return movement of the rupiah against the US dollar utilizing ARCH GARCH (1,1) method

Ricky Perdana Gozali, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20281846&lokasi=lokal>

---

Abstrak

Pergerakan nilai tukar rupiah terhadap US Dolar merupakan salah satu faktor yang sangat diperhatikan oleh pelaku ekonomi. Antisipasi yang telah menyebabkan krisis yang sangat dalam seperti pada tahun 1997. Sistem ekonomi terbuka memperbolehkan dana asing keluar masuk termasuk investasi di pasar keuangan domestik. Kepemilikan asing pada instrumen investasi domestik akan mempengaruhi pasokan dan permintaan valuta asing didalam negeri yang berpengaruh pada nilai tukar Rupiah. Karya akhir ini akan melihat pengaruh kepemilikan asing pada surat berharga negara dan pada sertifikat Bank Indonesia terhadap pergerakan return nilai tukar Rupiah terhadap US Dollar. Metode regresi yang digunakan adalah metode ARCH dan GARCH (1.1) pada periode pengamatan 2008-2010 hasil analisa diharapkan dapat memberikan gambaran lebih jelas mengenai hubungan ketiga variable tersebut.