

Analisis interest rate, stock returns, dan Implied volatility terhadap credit default swap (CDS) di Indonesia

Dewi Nurzalita Aini, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20289459&lokasi=lokal>

Abstrak

Skripsi ini menganalisis interest rate, stock returns, dan implied volatility terhadap Credit Default Swap (CDS) di Indonesia. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh interest rate, stock returns, dan implied volatility sebagai determinan terhadap Credit Default Swap (CDS) di Indonesia. Sebagai proxy untuk interest rate menggunakan yield SUN dengan tenor 10 tahun, stock returns menggunakan return IHSG dan implied volatility menggunakan vstox index.

Penelitian ini adalah penelitian kuantitatif dengan desain eksplanatif dan menggunakan program statistik SPSS versi 17. Pengumpulan data sebagian besar dilakukan dengan mengambil data dari Bank Indonesia.

Hasil penelitian ini membuktikan bahwa terdapat pengaruh signifikan dari interest rate, stock returns, dan implied volatility terhadap CDS spreads di Indonesia.

.....This research analyze interest rate, stock returns, and implied volatility to credit default swap (CDS) in Indonesia. The aim of this research, is to get the conclusion about the influence of interest rate, stock returns, and implied volatility as the determinants to CDS in Indonesia. As a proxy, for interest rate use government bond (SUN) yields with maturities ten years, stock returns use IHSG returns, and implied volatility use vstox index.

This research was quantitative with design explanative and using software SPSS version 17. Data were collected from Bank Indonesia.

The result of this research proved that there was significant influence of interest rate, stock returns, and implied volatility to credit default swap (CDS) spreads in Indonesia.