

Analisis peran diversifikasi aset bitcoin pada portofolio aset finansial global: studi empiris periode 2013 - 2017 = Diversification analysis of bitcoin asset in global financial assets portfolio: empirical study period 2013 - 2017

Nico Julianto Efendi, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20477192&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini akan memberikan perspektif luas atas efek dari penyertaan bitcoin pada portofolio yang terdiversifikasi dengan baik. Portofolio terdiri atas saham, bond, kurs keras, komoditi luas, hedge fund, properti, indeks dolar, dan indeks futures. Hasil yang didapat konsisten dengan penelitian sebelumnya. Kami menemukan bahwa penyertaan bitcoin dapat menurunkan risiko portofolio dan membuat efficient set portofolio lebih baik.

ABSTRACT

This study will give a broad perspective on the effect of including bitcoin in a well diversified portfolio of worldwide stocks, bonds, hard currencies, broad commodities, hedge funds, real estate, dollar index, and index futures. Our findings show that the results are consistent with past research. We find that the inclusion of bitcoin is able to reduce the risk in portfolio and improve the portfolio's efficient set.