

Analisis Pengaruh Shock BI Rate Terhadap Return dan Volatilitas Saham Perbankan di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2008 - 2016 = Analysis of The Effect of Shock BI Rate on Return and Volatility of Banking Shares in Indonesia Stock Exchange Period 2008 - 2016

Juli Hartawan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20513852&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini menganalisis bagaimana Shock BI Rate mempengaruhi return dan volatilitas saham perbankan di Bursa Efek Indonesia. Setelah diuji menggunakan OLS (Ordinary Least Squares) dan GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) menunjukkan bahwa Shock BI Rate berpengaruh secara signifikan terhadap return dan volatilitas saham perbankan dengan kapitalisasi yang sangat besar. Selanjutnya, hasil dari penelitian ini dapat digunakan sebagai panduan bagi investor individu dan manajer portofolio untuk menentukan waktu yang tepat dalam mengambil keputusan untuk membeli atau menjual saham perbankan dalam hal terjadi Shock BI Rate.

.....This study explains how the Shock BI Rate influences the return and volatility of banking stocks in Indonesia Stock Exchange after tested using OLS (Ordinary Least Squares) and GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) showed that Shock BI Rate significantly influenced the return and volatility of very large capitalization banking stocks. Furthermore, the results of this research can be used as a guide for individual investors and portfolio managers to determine the right time in taking a decision to buy or sell on banking shares in the event of Shock BI Rate.