

Analisis hubungan beta capm dengan beta multifactor models

Harahap, Stevie Constant, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=119988&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan dari tesis ini adalah melihat bagaimana hubungan antara beta CAPM dengan beta Multifactor Models. Yang menjadi variabel dependen ialah beta CAPM. Dan variabel independennya ialah beta inflasi, beta nilai tukar, dan beta suku bunga. Sampel yang dipilih merupakan saham-saham yang termasuk kategori LQ45 selama periode 2005-2007 yaitu sebanyak 12 saham. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa hanya variabel beta inflasi yang mempunyai pengaruh signifikan terhadap beta CAPM, sedangkan variabel beta nilai tukar dan beta suku bunga tidak.....The purpose of this thesis is to see how the relationship between beta CAPM and beta Multifactor Models. The dependent variable is the CAPM beta. And the independent variables are inflation beta, exchange rate beta, and interest rate beta. The sample selected is stocks that are included in the LQ45 category during the period 2005-2007, which are 12 stocks. The results of this study indicate that only the inflation beta variable has a significant effect on the CAPM beta, while the exchange rate beta and interest rate beta do not. Keywords.