

Analisis pengaruh risiko sistematis dan firm-specific risk terhadap risiko kredit pada bursa efek Indonesia periode 2005-2011 / Rahmat Aryo Baskoro

Rahmat Aryo Baskoro, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20419149&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh risiko sistematis/makroekonomi dan firm-specific risk terhadap risiko kredit pada seluruh perusahaan yang tercatat di Bursa Efek Indonesia selama periode tujuh tahun mulai dari tahun 2005 sampai dengan tahun 2011. Pengujian dilakukan dengan model regresi logistik. Hasil penelitian ini menemukan bahwa risiko sistematis/makroekonomi dan risiko karakteristik perusahaan memiliki pengaruh terhadap risiko kredit.

ABSTRACT

This research is aimed to analyze the effect of systematic risk/macroeconomics variable and idiosyncratic/firm-specific risk in Indonesia Stock Exchange, 2005 - 2011. The test is conducted with regression of logistic model. This research found that systematic risk/macroeconomics and idiosyncratic/firm-specific risk effect to credit risk.