

Perbandingan Metode Ridge Regression dan Support Vector Regression dalam Analisis Ketahanan Perusahaan di Indonesia dari Pengaruh Utang Luar Negeri = Comparison of Ridge Regression and Support Vector Regression in the Analysis of Indonesian Company Resilience from the Effect of Foreign Debt

Viane Angelia De Deeva, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920551581&lokasi=lokal>

Abstrak

Utang luar negeri Indonesia selama periode tahun 2011 sampai dengan 2022 cenderung terus meningkat. Pada tahun 2022, utang luar negeri Indonesia mengalami kenaikan pertumbuhan sebesar 4,1% YoY (Year on Year) dari tahun 2021. Selain disebabkan oleh pemerintah dan sektor swasta, masalah ini juga dipengaruhi oleh pelemahan mata uang dolar Amerika Serikat terhadap mayoritas mata uang global. Skripsi ini menganalisis ketahanan perusahaan di Indonesia yang memiliki utang luar negeri terhadap kebangkrutan saat terjadi depresiasi nilai tukar mata uang menggunakan metode machine learning yaitu Ridge Regression dan Support Vector Regression. Skripsi ini mengamati neraca perusahaan dari 50 perusahaan sektor non-keuangan yang menjadi emiten di Bursa Efek Indonesia dari tahun 2011 sampai dengan 2022. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa metode Ridge Regression dan Support Vector Regression memiliki kinerja yang setara dalam menghasilkan akurasi prediksi. Hasil analisis untuk keseluruhan sampel dan kelompok importir (baik eksportir maupun non-eksportir) menunjukkan competitiveness effect lebih dominan dari balance-sheet effect. Namun, untuk kelompok non-importir (baik eksportir maupun non-eksportir) menunjukkan balance-sheet effect lebih dominan dari competitiveness effect. Sehingga, kelompok perusahaan tersebut disarankan untuk meminimalisasikan transaksi utang luar negeri agar perusahaan dapat tetap bertahan.

..... Indonesia's foreign debt has exhibited a continuous upward trajectory during the period 2011 to 2022. In 2022, the country's foreign debt experienced a year-on-year growth of 4.1% compared to 2021. In addition to being caused by government and private sector activities, this issue was also influenced by the depreciation of the United States dollar against the majority of global currencies. This thesis analyzes the resilience of Indonesian companies with foreign debt against bankruptcy during exchange rate depreciation using machine learning methods, specifically Ridge Regression and Support Vector Regression. This study examines the balance sheets of 50 non-financial sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange from 2011 to 2022. The results of this research indicate that the Ridge Regression and Support Vector Regression methods have comparable performance in producing prediction accuracy. The results of the analysis for all samples and the importer groups (both exporters and non-exporters) show that the competitiveness effect is more dominant than the balance-sheet effect. However, for the non-importer group (both exporters and non-exporters) it shows that the balance-sheet effect is more dominant than the competitiveness effect. Thus, it is recommended for companies within this group to minimize foreign debt transactions so that these companies can enhance their resilience.