

Nama : LUTHFIAN AL RASYID WIRATAMA
NIM : 3023212003
Judul Tugas Akhir : ANALISIS FAKTOR BI 7 DAYS REPO RATE, INFLATION,
DAN MATURITY TERHADAP YIELD TO MATURITY
OBLIGASI PEMERINTAH SERI FR YANG TERCATAT DI
KUSTODIAN SENTRAL EFEK INDONESIA PADA
PERIODE 2018 – 2022

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan menganalisa pengaruh BI 7 Days Repo Rate, Inflation, dan Maturity terhadap Yield to Maturity obligasi pemerintah seri FR yang tercatat di Kustodian Sentral Efek Indonesia pada periode 2018-2022.

Metodologi penelitian yang digunakan adalah metode kuantitatif dengan data cross section dan data sekunder yang diperoleh dari website resmi perusahaan terkait, Bursa Efek Indonesia, Kustodian Sentral Efek Indonesia, Indonesia Bond Pricing, Badan Pusat Statistik, Bank Indonesia. Teknik pengambilan sample menggunakan metode purposive sampling dengan data pada tahun 2018 - 2022. Teknik analisis data yang digunakan adalah regresi linier berganda, uji asumsi klasik (uji multikolinearitas), uji hipotesis t-statistik serta f-statistik untuk menguji keberartian pengaruh secara bersama-sama dengan tingkat signifikansi 5%, dan uji koefisien determinasi.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial variabel BI 7 Days Repo Rate berpengaruh negatif dan signifikan terhadap Yield to Maturity Obligasi Pemerintah Seri FR, Sedangkan Hasil dari Inflation dan Maturity berpengaruh positif dan signifikan terhadap Yield to Maturity Obligasi Pemerintah Seri FR. Sementara itu secara simultan variabel bebas BI 7 Days Repo Rate, Inflation, dan Maturity secara bersama-sama memiliki hubungan yang signifikan terhadap variabel terikatnya yaitu Yield to Maturity Obligasi Pemerintah Seri FR. Koefisiensi determinasi dari penelitian ini menunjukkan angka sebesar 93,3% memperlihatkan bahwa variasi variabel bebas BI 7 Days Repo Rate, Inflation, dan Maturity mampu menjelaskan variasi naik turunnya variabel terikat Yield to Maturity Obligasi Pemerintah Seri FR sebesar 93,3%, sedangkan sisanya sebesar 6,7% dipengaruhi oleh variabel bebas lainnya.

Kata kunci : BI 7 Days Repo Rate, Inflation, Maturity, dan Yield Obligasi Pemerintah Seri FR.

Penulis

Luthfian Al Rasyid W.
35112180007

Name : LUTHFIAN AL RASYID WIRATAMA
ID : 3023212003
Final Project Title : Analyze The BI 7 Days Repo Rate, Inflation, And Maturity Factors on Yield to Maturity Of FR Series Government Bonds Listed at The Indonesian Central Securities Custodian in the Period 2018-2022.

ABSTRACT

This study aims to analyze the BI 7 Days Repo Rate, Inflation, and Maturity factors on Yield to Maturity of FR series Government Bonds listed at the Indonesian central securities custodian in the period 2018-2022.

The research methodology used is a quantitative method with cross section data and secondary data obtained from the official website of the relevant company, the Indonesia Stock Exchange, the Indonesian Central Securities Depository, Indonesia Bond Pricing, the Central Statistics Agency, Bank Indonesia. The sampling technique used purposive sampling method with data in 2018 - 2022. The data analysis technique used was multiple linear regression, classical assumption test (multicollinearity test), t-statistical hypothesis testing and f-statistics to test the significance of the influence together with a significance level of 5%, and the coefficient of determination test.

The results of this research show that partially the BI 7 Days Repo Rate variable has a negative and significant effect on the Yield to Maturity of FR Series Government Bonds, while the results of Inflation and Maturity have a positive and significant effect on the Yield to Maturity of FR Series Government Bonds. Meanwhile, simultaneously the independent variables BI 7 Days Repo Rate, Inflation, and Maturity together have a significant relationship with the dependent variable, namely Yield to Maturity of FR Series Government Bonds. The coefficient of determination from this research shows a figure of 93.3%, showing that variations in the independent variables BI 7 Days Repo Rate, Inflation and Maturity are able to explain variations in the ups and downs of the dependent variable Yield to Maturity Government Bonds FR Series by 93.3%, while the remainder is 6.7% is influenced by other independent variables.

Keywords : BI 7 Days Repo Rate, Inflation, Maturity, and FR Series Government Bond Yield.

Author

Luthfian Al Rasyid W.
35112180007