

Analisis kointegrasi harga minyak dunia, Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), dan Produk Domestik Bruto (PDB) di Indonesia tahun 1995-2010 = Cointegration analysis of world oil prices, Composite Stock Price Index (CSPI), and the Gross Domestic Product (GDP) in Indonesia year 1995-2010

Septian Nugraha Cahya Putra, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20296309&lokasi=lokal>

Abstrak

Skripsi ini adalah sebuah analisa mengenai kointegrasi harga minyak dunia, Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), dan Produk Domestik Bruto (PDB) di Indonesia. Data yang digunakan oleh peneliti adalah data Harga minyak dunia yang menggunakan proxy Harga Minyak West Texas Intermediate (WTI, Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), dan Produk Domestik Bruto (PDB) di Indonesia. Penelitian ini akan menguji ketiga data dari masing-masing variabel untuk mengetahui sifat ketiga data yang digunakan, stasioner atau non-stasioner. Hal ini merupakan syarat untuk melakukan uji kointegrasi.

Penelitian ini akan melihat sebuah pola dan karakteristik hubungan jangka panjang yang terbentuk dari ketiga variabel tersebut dengan menggunakan model penelitian Johansen Test Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif yang bertujuan untuk eksplanatif kointegrasi antara ketiga variabel tersebut. Hasil penelitian ini menunjukkan adanya kointegrasi yang signifikan diantara harga minyak dunia, Indeks Harga Saham Gabungan, dan Produk Domestik Bruto (PDB).

.....This thesis is an analysis of world oil prices cointegration, Composite Stock Price Index (CSPI), and the Gross Domestic Product (GDP) in Indonesia. The data that used by researchers is the world's oil price data that using the proxy of West Texas Intermediate (WTI) oil price, Composite Stock Price Index (CSPI), and the Gross Domestic Product (GDP) in Indonesia.

This study will examine three data from each variable to know these three variables characteristic, stasioner or non-stasioner. This is a requirement to perform cointegration tests. The study will look at a pattern and characteristics of long-term relationships that are formed from these three variables using the Johansen test research model. This research is a quantitative study that aims to explanative cointegration between these three variables. The results of this study indicate a significant cointegration between oil prices, the Composite Stock Price Index and Gross Domestic Product (GDP).