

Analisis pengaruh indeks saham global dan regional terhadap JCI : periode Agustus 2008-Juli 2010 dan Agustus 2010-Juli 2012 = The analysis of affect from global and regional stocks index to JCI : period of August 2008-July 2010 and period of August 2010-July 2012

Irwan Mulawarman, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20365471&lokasi=lokal>

---

Abstrak

Tesis ini membahas pengaruh dari empat indeks saham (variabel bebas), yaitu: DJIA (Amerika), DAX (Jerman), NKY (Jepang) dan FSSTI (Singapore) terhadap JCI (Indonesia) sebagai variabel terikat. DJIA mewakili Indeks saham global sementara DAX, NKY dan FSSTI mewakili indeks saham regional.

Hipotesa: Pengaruh ke-4 variabel bebas tersebut terhadap JCI diperkirakan signifikan pada periode krisis subprime mortgage di AS dan krisis surat utang di UE. Analisis ini menggunakan metodologi uji korelasi, uji regresi OLS dan uji kausalitas Granger. Hasil yang diperoleh ternyata dalam kedua periode pengujian, hanya DJIA dan FSSTI yang berpengaruh signifikan terhadap JCI.

<hr>

This thesis analyzes the influence of the four stock indices (independent variables): DJIA (USA), DAX (Germany), NKY (Japan) and FSSTI (Singapore) to JCI (Indonesia) as the dependent variable. The DJIA represents global stock index while DAX, NKY and FSSTI represent regional stock indices. Hypothesis: All of independent variable would influence the independent variables significantly in the period of the subprime mortgage crisis in the USA and debt crisis in the EU. This analysis uses correlation test methodology: OLS regression test and Granger causality test. The results show that only DJIA and FSSTI influence JCI significantly on both period tests.