Universitas Indonesia Library >> Artikel Jurnal

Contagion effect dan integrasi pasar modal di kawasan Asia, Eropa dan Amerika

Robiyanto, author

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=20497440&lokasi=lokal

---

Abstrak

ABSTRAK
Integrasi pasar modal merupakan topik yang masih sangat menarik untuk dikaji karena senantiasa berkembang seiring dengan perkembangan waktu dan kondisi yang terjadi pada pasar modal pasar modal yang ada di dunia. Penelitian ini mengkaji integrasi pasar modal dan contagion effect dari pasar modal di Asia, Eropa dan Amerika. Penelitian ini menggunakan data penutupan bulanan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) untuk Indonesia, Kuala Lumpur Composite Index (KLCI) untuk Malaysia, PSE Composite Index (PSE) untuk Filipina, Straight Times Index (STI) untuk Singapura, SET Index (SET) untuk Thailand, NIKKEI 225 untuk Jepang, FTSE 100 untuk Inggris, DAX 30 untuk Jerman, CAC 40 untuk Prancis, IBEX 35 untuk Spanyol, Dow Jones untuk Amerika Serikatselama periode bulan Januari 2012 sampai dengan Desember 2016. Hasil penelitian ini adalah tidak terdapat comovement antara pasar modal Indonesia, Malaysia, Filipina, Singapura, Thailand, Jepang, UK, Jerman, Perancis, Italia, Spanyol, dan Amerika Serikat.