

Valuasi Pasar Modal menggunakan pendekatan The Fed Model di Wilayah Asia tahun 2003-2011 = Market valuation using The Fed Model approach in Asia area period of 2003-2011

Vindaniar Yuristamanda Putri, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20303301&lokasi=lokal>

Abstrak

Skripsi ini menganalisis mengenai kondisi pasar modal di wilayah Asia dengan pendekatan The Fed Model. Tujuan dari penelitian ini untuk melakukan valuasi pasar modal di wilayah Asia pada tahun 2003-2011. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif. Model penelitian yang digunakan berdasarkan pendekatan The Fed Model yang memiliki tiga tahapan pengujian yaitu, uji korelasi antara saham dengan obligasi, uji valuation gaps, dan uji kointegrasi. Penelitian ini menggunakan tujuh negara sebagai sampel yang dipilih berdasarkan peringkat hutang. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa dari tujuh negara yang diambil untuk sampel hanya satu negara yang lolos dalam tiga pengujian The Fed Model.

.....This thesis analyzes the stock market condition before, during, and after financial crisis in United States using The Fed Model Approach. The purpose of this study is valuing the capital markets in Asia years of 2003-2011. This study uses a quantitative approach. The research model used by the approach of The Fed Model has three stages of testing namely, stock-bond correlation test, valuation gaps test, and cointegration test. This study uses seven countries as samples that were selected based on credit ratings. The result of this study showed that among seven countries that are taken as a sample, only one country that passed the three tests of the Fed Model.