

Pengaruh pergerakan harga minyak mentah terhadap indeks saham sektor pertambangan = The influence of crude oil price to mining sector index / Rima Dimiati

Rima Dimiati, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20329862&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh dari pergerakan harga minyak mentah Indonesia dan variabel makroekonomi terhadap indeks harga saham sektor pertambangan. Variabel makroekonomi yang digunakan dalam penelitian ini adalah suku bunga SBI, nilai tukar rupiah terhadap dollar Amerika Serikat, dan inflasi. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yang dari Januari 2005 s/d Desember 2011. Pengolahan data dalam penelitian ini menggunakan teknik analisis vector error correction model (VECM) dengan menggunakan data time series. Hasil dari pengolahan data menunjukkan bahwa variabel harga minyak mentah Indonesia paling berpengaruh terhadap indeks harga saham pertambangan.

ABSTRACT

This research is aimed to indentify the influence of Indonesian crude oil price and macro economic variables to the Mining Sector Index. The macro variabel used are, rate of certified of Bank Indonesia, the exchange rate of rupiah to dollar US, and inflation. Data used in this research is secondary data from January 2005 to December 2011. Research method used in this study is Vector Error Correction Model and used time series data. The result of this research shows that the crude oil price significantly to mining sector index.