

Analisis volatility spillover antara harga minyak dunia dengan lima indeks saham sektoral di Indonesia, Singapura, Korea dan Hong Kong = Volatility spillover analysis between world oil price and five sectoral index in Indonesia, Singapore, Korea and Hong Kong

M. Ali Ridwan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20331741&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis ada tidaknya volatility spillover antara harga minyak dengan lima saham sektoral, yaitu sektor basic material, sektor financial, sektor consumer service, sektor telecommunication, dan sektor oil & gas. Penelitian ini dirancang untuk melihat volatility spillover tersebut di Indonesia, Singapura, Korea, dan Hongkong. Selain itu, penelitian ini juga ingin melihat keterkaitan antar pasar saham di Indonesia, Singapura, Korea, dan Hongkong. Model penelitian ini menggunakan model multivariate BEKK GARCH yang dikembangkan oleh Kroner dan Engle(1995).

.....This research is conducted to analyzing the volatility transmission between crude oil five stock sector, which are basic material, financial, consumer service, telecommunication, and oil & gas. This research take a sample of volatility transmission in Indonesia, Singapura, Korea, and Hong Kong. This research also want to know market interdependence between those four country. I use model multivariate BEKK GARCH which developed by Kroner and Engle (1990).