

Analisis perilaku investasi pada Bursa Efek Indonesia dengan menggunakan Metode Wavelet = investment behavior analysis at the Indonesian stock exchange using wavelet

Roy Kristiawan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20341331&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan tesis ini adalah untuk menguji efisiensi dari Bursa Efek Indonesia dengan melihat perilaku random walk pada Indeks Harga Saham Gabungan dan Indeks sektoral yang terjadi dalam periode harian. Pengujian atas perilaku random walk salah satunya adalah dengan menggunakan korelasi antara perubahan harga sekarang dengan harga sebelumnya. Penelitian ini menggunakan dua metode korelasi. Metode korelasi yang pertama adalah yang umum digunakan yaitu korelasi dengan menggunakan statistik deskriptif dan metode kedua adalah dengan menggunakan korelasi wavelet. Hasil dari kedua metode tersebut memperlihatkan adanya pola random walk untuk periode harian.

<hr>

The purpose of this thesis is to test the efficiency of the Indonesia Stock Exchange particular with a random walk behavior for Composite Index and Sectoral Indices that occurred in daily period. One of method to Tests random walk behavior is to use correlation between changes in current prices with previous prices. This thesis used two methods of correlation. The first method is commonJy used in statistics and the second method is by using wavelet correlation. Results from both methods showed random walk behaviour for daily period.