

Analisis pengaruh perubahan harga minyak terhadap pengembalian saham pada Negara Cina, Indonesia, Jepang, dan Korea Selatan = Analysis of the effect of oil price changes regarding stock return in China, Indonesia, Japan and South Korea

Sitinjak, Johanna Berlian Kristianti, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20433723&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Minyak mentah dapat dikatakan komoditi yang sangat penting secara global. Hampir setiap negara bergantung pada minyak baik produsen maupun konsumen. Dari sudut pandang teoretis, fluktuasi harga minyak dapat mempengaruhi pasar keuangan melalui berbagai hal. Penelitian ini memeriksa akan hubungan yang ada antara perubahan harga minyak dan pengembalian saham. Dalam penelitian ini, penulis menggunakan analisis vector autoregressive atau VAR dengan piranti lunak Eviews. Pada penelitian ini perubahan harga minyak akan dibagi menjadi tiga yaitu: linier, asimetrik dan nonlinier

ABSTRACT

Crude oil is a very important commodity. Almost every country dependent on oil, either they are producers or consumers. From the theoretical point of view, fluctuations in oil prices can affect financial markets through various things. This study will examine the existing relationship between oil price changes and stock returns.

In this study, the author use vector autoregressive or VAR analysis with software Eviews. In this study, changes in the changes of oil price will be divided into three: linear, asymmetric and non-linear