

Integrasi pasar saham negara kawasan Uni Eropa, NAFTA dan Asia = Integration of European Union, NAFTA and Asia Stock Markets

Umi Mujahadah, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20479632&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini membahas mengenai integrasi pasar saham negara kawasan Uni Eropa, NAFTA dan Asia. Pasar saham yang menjadi objek penelitian adalah Inggris, Perancis, Jerman, Amerika Serikat, Kanada, Meksiko, Indonesia, Malaysia, Singapura, Filipina, Thailand, Hongkong, China, Jepang dan Korea Selatan. Periode penelitian dari Januari 2008 sampai Desember 2016. Metode yang digunakan adalah uji akar unit, uji kointegrasi, Vector Autoregressive (VAR), Impulse Responses Function dan uji kausalitas Granger. Hasilnya menunjukkan bahwa pasar saham Amerika Serikat dan China memiliki pengaruh yang besar dibandingkan dengan pasar saham lain.

.....This study examines the integration of European Union, Nafta and Asia stock markets. These countries include, England, France, German, USA, Canada, Mexico, Indonesia, Malaysia, Singapore, Phillipines, Thailand, Hongkong, China, Japan and South of Korea peiod starting from January 2008 to December 2016. Unit root, Co-integration test, Vector Autoregressive (VAR), Impulse Responses Function and Granger Causality Test are employed. The results showed that USA and China stock markets have significant impact with others stock market.