

Pergerakan bersama (comovements) pasar saham internasional: pendekatan statistik non parametrik

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=114505&lokasi=lokal>

Abstrak

Jika kita amati pergerakan indeks di suatu pasar bursa tidak terlepas dari pengaruh pasar bursa yang lainnya. Sehingga timbul suatu pertanyaan apakah pola pergerakan pasar saham internasional telah terintegrasi atau tersegmentasi. Untuk menjawab pertanyaan tersebut maka tulisan ini dibuat dalam bentuk kajian empirikal terhadap pergerakan indeks mingguan pasar saham internasional. Meliputi tujuh pasar saham yang dijadikan