

Volatility spillover antara harga minyak mentah dunia terhadap indeks LQ45 dan Jakarta Islamic Index = Volatility spillover between crude oil prices LQ45 index and Jakarta Islamic Index

Mirza Azkia, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20474520&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis mengenai volatility spillover antara harga minyak, indeks LQ45 dan Jakarta Islamic Index pada periode bulan Juli 2010 sampai dengan Februari 2018. Model yang digunakan pada penelitian ini adalah bivariate GARCH 1,1-full BEKK. Hasil empiris pada penelitian ini, yaitu ditemukannya bukti bahwa terdapat volatility spillover baik antara harga minyak mentah dunia dengan indeks LQ45 maupun Jakarta Islamic Index.

.....This study intends to examine the volatility spillover between crude oil prices, LQ45 index and Jakarta Islamic Index from July 2010 to February 2018. The model utilized as a part of this exploration is bivariate GARCH 1,1 full BEKK. The exact outcome in this exploration is discovering confirmation of a decent volatility spillover from crude oil prices to LQ45 index and oil prices to Jakarta Islamic Index.