

**DEPARTEMEN PENDIDIKAN NASIONAL**

**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

**PROGRAM STUDI: EKONOMI PEMBANGUNAN  
DAFTAR NO. :**

**ABSTRAK  
SKRIPSI SARJANA EKONOMI**

NAMA : DITA AYU P.  
N.I.M. : 040911073  
TAHUN PENYUSUNAN : 2015

**JUDUL :**

ANALISIS HUBUNGAN ANTARA FDI (FOREIGN DIRECT INVESTMENT) DAN HARGA SAHAM DI KAWASAN ASEAN-5 (SINGAPURA, INDONESIA, MALAYSIA, THAILAND, FILIPINA) MELALUI PENDEKATAN PANEL GRANGER CAUSALITY

**ISI :**

Perkembangan FDI dan pasar saham di kawasan ASEAN dinilai cukup signifikan. Hal ini dapat dilihat dari naiknya pendapatan perkapita negara-negara di ASEAN yang diikuti oleh pertumbuhan ekonomi. Aliran modal masuk bagi negara-negara emerging markets seperti di kawasan ASEAN-5 merupakan sumber pembiayaan pembangunan dan dapat mendukung pengembangan pasar keuangan domestik.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui hubungan antara FDI dan harga saham di kawasan ASEAN-5. Penelitian ini menggunakan variabel FDI dan harga saham dengan menggunakan pendekatan Panel *Granger Causality* dan menggunakan data panel secara tahunan selama periode 2005-2014. Hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat hubungan satu arah antara FDI (Foreign Direct Investment) dan harga saham di kawasan ASEAN-5.

**KATA KUNCI** : *FDI*, harga saham, data panel, ASEAN-5, dan *Panel Granger Causality*.