

Analisis Pengaruh Perubahan Harga Minyak Terhadap Tingkat Pengembalian Indeks Sektorial Bursa Efek Indonesia Pada Periode Sebelum Krisis (Januari 2006-Desember 2007), Saat Krisis (Januari 2008-Juni 2009) Dan Pasca Krisis Ekonomi 2008 (Juli 2009-Desember 2014) = Analysis of The Impact of Oil Price Change on Indonesia Stock Exchange Sectorial Index Return on Pre-Crisis (January 2006-December 2007), Within the Financial Crisis (January 2008-June 2009), and Post-Crisis 2008 (July 2009-December 2014)

Andrie Zainal Zen, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20466689&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dampak perubahan harga minyak terhadap return indeks sektoral pada periode pra krisis, saat krisis, dan pasca krisis finansial 2008 maupun pada periode 2006-2014 secara keseluruhan. Dengan menggunakan 10 indeks sektoral BEI sebagai objek, penelitian ini mengungkapkan bagaimana harga minyak mempengaruhi return indeks sektoral masing-masing industri pada periode-periode tersebut dengan menggunakan data harian melalui metode Ordinary Least Square untuk estimasi masing-masing industri.

ABSTRACT

This research aims to estimate the effect of oil price change on IDX sectorial index return pre crisis, within the financial crisis, and post crisis 2008 and also in 2006 2014 as a whole. By using 10 IDX sectorial indices as the object, this research shows how oil price change affects sectorial index return of each industry in those periods through Ordinary Least Square for each industry estimation.