

Analisis Korelasi Harga Minyak Dunia dan Nilai Tukar USD/IDR terhadap Saham Transportasi dan logistik Menggunakan Metode DCC GARCH pada Periode Sebelum dan Saat Pandemi COVID-19 di Indonesia = Analysis of the Correlation between Global Oil Prices and USD/IDR Exchange Rate on Transportation and Logistik Stocks Using DCC GARCH Method during Pre-Pandemic and COVID-19 Period in Indonesia

Ario Fareiza Akbar, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920524713&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengidentifikasi hubungan antara perubahan harga minyak global dan nilai tukar USD/IDR dengan tingkat pengembalian investasi di sektor transportasi dan logistik di Indonesia. Penelitian ini akan menganalisis periode sebelum dan setelah pandemi COVID-19 untuk memahami apakah ada korelasi yang signifikan antara variabel-variabel tersebut. Fokusnya adalah melihat bagaimana fluktuasi harga minyak dunia dan perubahan nilai tukar USD/IDR dapat memengaruhi pengembalian saham di sektor transportasi dan logistik di Indonesia. Data penelitian yang digunakan adalah data return dari harga minyak dunia WTI (West Texas Intermediate), nilai tukar USD IDR dan saham sektor transportasi & logistik yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini menggunakan data kuantitatif, metode yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan analisis dekripsi data statistik dan menggunakan DCC GARCH. Dalam menganalisis data dari penelitian ini menggunakan program R. Dari hasil studi, diperoleh informasi bahwa harga minyak dunia WTI memiliki pengaruh positif terhadap harga saham sektor transportasi & logistik dan nilai tukar memiliki korelasi negatif dengan harga saham sektor transportasi & logistik. Mengetahui korelasi diharapkan dapat mengurangi atau memitigasi risiko investasi pada saham sektor transportasi dan logistik di Indonesia.

.....The purpose of this study is to identify the relationship between changes in global oil prices and the USD/IDR exchange rate and investment returns in the transportation and logistics sectors in Indonesia. The study will analyze the periods before and after the COVID-19 pandemic to understand if there is a significant correlation between these variables. The focus is to examine how fluctuations in global oil prices and changes in the USD/IDR exchange rate can impact stock returns in the transportation and logistics sectors in Indonesia. The research data used in this study includes return data from WTI (West Texas Intermediate) crude oil prices, the USD/IDR exchange rate, and stocks from the transportation and logistics sectors listed on the Indonesia Stock Exchange. This research adopts a quantitative approach, utilizing statistical data analysis and employing the DCC-GARCH method. The data analysis is conducted using the R programming language. The study findings reveal that WTI crude oil prices have a positive influence on stock prices in the transportation and logistics sector, while the exchange rate shows a negative correlation with stock prices in the sector. Understanding these correlations is expected to help mitigate investment risks in transportation and logistics stocks in Indonesia.