

Pengaruh Pertambahan Kasus Positif dan Kematian akibat COVID-19 di Indonesia terhadap Return Indeks Sektoral JASICA (Jakarta Stock Industrial Classification) pada Tahun 2020 – 2021 = The Effect of the Increase in Positive Cases and Deaths due to COVID-19 in Indonesia on the Return of the JASICA (Jakarta Stock Industrial Classification) Sectoral Index in 2020 - 2021

Shafia Nabila, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920559364&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh pertambahan harian kasus positif dan pertambahan harian kasus kematian akibat COVID-19 di Indonesia serta pengaruh arus dana asing terhadap return sembilan indeks sektoral JASICA. Periode penelitian dimulai sejak tanggal 2 Maret 2020 hingga 31 Maret 2021. Metode penelitian yang digunakan adalah regresi data time series dengan metode OLS. Hasilnya, peneliti menemukan pengaruh yang berbeda-beda pada masing-masing sektor. Mayoritas sektor memiliki respons negatif yang tidak signifikan terhadap pertambahan kasus positif. Sementara itu, pertambahan kasus kematian memberikan pengaruh negatif yang signifikan terhadap return mayoritas sektor. Terakhir, arus dana asing memberikan pengaruh positif pada return indeks seluruh sektor.

..... This study aims to determine the effect of the daily increase in positive cases and deaths due to COVID-19 in Indonesia and the effect of foreign fund flows on the returns of the JASICA sectoral indices. The research period starts from March 2, 2020 to March 31, 2021. This research used time series data regression with the OLS method. The findings indicate that the majority of sectors have an insignificant negative response to the increase in positive cases. Meanwhile, the increase in death cases has a significant negative effect on the return of the majority of sectors. This research also finds that the flow of foreign funds has a positive influence on the returns of all sectors.