

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SERTIFIKASI	ii
PENGESAHAN TESIS.....	iii
MOTTO	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
 BAB I PENDAHULUAN.....	 1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	10
1.3 Tujuan Penelitian dan Kegunaan Penelitian	11
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	11
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	12
1.4 Sistematika Penulisan.....	13
 BAB II TELAAH PUSTAKA	 15
2.1 Landasan Teori.....	15
2.1.1 <i>Efficient Market Hypothesis</i>	15
2.1.2 <i>Signalling Theory</i>	17
2.1.3 Pasar Modal.....	18
2.1.4 Indeks Harga Saham Gabungan	19
2.1.5 Pengembalian Saham	20
2.1.6 Kasus Positif COVID-19	21
2.1.7 Nilai Pasar terhadap Nilai Buku	22
2.1.8 Kapitalisasi Pasar	23
2.1.9 Pengembalian Ekuitas	23

2.1.10	<i>Lockdown</i>	24
2.1.11	<i>Travel Ban</i>	24
2.1.12	Sektor Saham	25
2.2	Penelitian Terdahulu	25
2.3	Pengembangan Hipotesis	32
2.3.1	Pengaruh kasus positif Covid-19 terhadap Pengembalian Saham.....	32
2.3.2	Pengaruh Nilai Pasar terhadap Nilai Buku terhadap Pengembalian Saham	34
2.3.3	Pengaruh Kapitalisasi Pasar terhadap Pengembalian Saham. .	35
2.3.4	Pengembalian Ekuitas berpengaruh terhadap Pengembalian Saham.....	36
2.3.5	Kebijakan <i>Lockdown</i> terhadap Pengembalian Saham.....	37
2.3.6	Kebijakan <i>Travel ban</i> terhadap Pengembalian Saham	38
2.3.7	Pengaruh <i>Lockdown</i> terhadap Pengembalian Saham yang dimoderasi oleh sektor saham	39
2.3.8	Pengaruh <i>Travel Ban</i> terhadap Pengembalian Saham yang dimoderasi oleh sektor saham	40
2.4	Kerangka Pemikiran	41
BAB III METODE PENELITIAN		43
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	43
3.1.1	Variabel Penelitian	43
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	44
3.2	Populasi dan Sampel	47
3.3	Jenis dan Sumber Data	48
3.4	Metode Analisis Data.....	48
3.4.1	Uji Asumsi Klasik	48
3.4.2	Moderated Regression Analysis (MRA)	51
3.4.3	Uji Goodness of Fit	53
3.4.4	Uji Statistika F	53

3.4.5	Uji Statistik t.....	54
3.4.6	Uji koefisien Determinasi (R^2)	55
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		56
4.1	Gambaran Umum Objek Penelitian	56
4.2	Hasil Penelitian	56
4.2.1	Analisis Statistik Deskriptif	56
4.2.2	Analisis Verifikatif.....	72
4.3	Pembahasan	108
4.3.1	Pengaruh Kasus Positif <i>covid-19</i> terhadap Pengembalian Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN	108
4.3.2	Pengaruh Nilai Pasar terhadap Nilai Buku Terhadap Pengembalian Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	109
4.3.3	Pengaruh Kapitalisasi Pasar terhadap Pengembalian Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	111
4.3.4	Pengaruh Pengembalian Ekuitas terhadap Pengembalian Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	112
4.3.5	Pengaruh Kebijakan <i>Lock Down</i> terhadap Pengembalian Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	114
4.3.6	Pengaruh Kebijakan <i>Travel Ban</i> terhadap Pengembalian Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	115
4.3.7	Pengaruh Kebijakan <i>Lockdown</i> terhadap Pengembalian Saham yang Dimoderasi oleh Sektor Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	116
4.3.8	Pengaruh Kebijakan <i>Travel Ban</i> terhadap Pengembalian Saham yang Dimoderasi oleh Sektor Saham pada Perusahaan Go Public di ASEAN.....	117
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		119
5.1	Kesimpulan.....	119

5.2	Saran.....	122
5.2.1	Bagi Investor	123
5.2.2	Bagi peneliti selanjutnya	123
DAFTAR PUSTAKA.....		124
LAMPIRAN.....		132

