

DAFTAR ISI

| | |
|---|-----------|
| HALAMAN JUDUL | i |
| SERTIFIKASI | ii |
| PENGESAHAN TESIS..... | iii |
| MOTTO | iv |
| HALAMAN PERSEMBAHAN | v |
| ABSTRACT | vi |
| ABSTRAK | vii |
| KATA PENGANTAR..... | viii |
| DAFTAR ISI..... | x |
| DAFTAR TABEL | xiv |
| DAFTAR GAMBAR..... | xvi |
| DAFTAR RUMUS | xvii |
| | |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1 Latar Belakang | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 11 |
| 1.3 Ruang Lingkup | 13 |
| 1.4 Tujuan..... | 14 |
| 1.4.1 Tujuan..... | 14 |
| 1.4.2 Manfaat | 15 |
| | |
| BAB II TINJAUAN TEORI DAN TELAAH PUSTAKA | 16 |
| 2.1 Tinjauan Teori | 16 |
| 2.1.1 Signalling Theory | 16 |
| 2.1.2 Return Pasar Saham..... | 16 |
| 2.1.3 Nilai Tukar..... | 17 |
| 2.2 Penelitian Terdahulu | 18 |
| 2.3 Pengembangan Hipotesis | 22 |

| | | |
|---|--|-----------|
| 2.3.1 | Pengaruh Indeks Keketatan Respon Pemerintah Kepada Return Pasar Saham | 22 |
| 2.3.2 | Pengaruh Konfirmasi Positif COVID-19 Kepada <i>Return</i> Pasar Saham..... | 26 |
| 2.3.3 | Pengaruh Konfirmasi Kematian COVID-19 Kepada <i>Return</i> Pasar Saham..... | 27 |
| 2.3.4 | Pengaruh Vaksinasi COVID-19 Kepada <i>Return</i> Pasar Saham | 28 |
| 2.4 | Kerangka Model | 30 |
| BAB III METODE PENELITIAN | | 32 |
| 3.1 | Jenis Studi | 32 |
| 3.2 | Populasi dan Sampel | 32 |
| 3.2.1 | Populasi | 32 |
| 3.2.2 | Sampel | 33 |
| 3.2.3 | Teknik Sampling | 33 |
| 3.3 | Jenis data dan Sumber Data..... | 33 |
| 3.4 | Metode Pengumpulan Data | 34 |
| 3.5 | Variabel | 34 |
| 3.5.1 | Jenis Variabel | 34 |
| 3.5.2 | Definisi konsep dan Operasional Variabel | 35 |
| 3.6 | Metode Analisis Data..... | 39 |
| 3.6.1 | Statistik Deskriptif | 40 |
| 3.6.2 | Uji Asumsi Klasik..... | 41 |
| 3.6.3 | Uji Hipotesis..... | 43 |
| BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN | | 47 |
| 4.1 | Gambaran Umum Proyek Penelitian | 47 |
| 4.2 | Statistik Deskriptif..... | 48 |
| 4.3 | Uji Asumsi Klasik | 50 |
| 4.3.1 | Uji Normalitas | 50 |
| 4.3.2 | Uji Multikolinieritas | 55 |

| | | |
|----------------------------|--|-----------|
| 4.3.3 | Uji Heterokedstisitas | 57 |
| 4.3.4 | Uji Autokorelasi | 59 |
| 4.4 | Pengujian Model | 61 |
| 4.4.1 | Uji F | 61 |
| 4.4.2 | Uji t | 62 |
| 4.4.3 | Uji Koefisien Determinasi (R^2)..... | 64 |
| 4.5 | Uji Hipotesis | 65 |
| 4.6 | Pembahasan | 67 |
| 4.6.1 | Pengaruh Indeks Keketatan Respon Pemerintah Kepada Return Pasar Saham pada objek emiten yang terdaftar pada di Bursa Efek Indonesia, Malaysia, Singapura, Thailand, dan Vietnam | 68 |
| 4.6.2 | Pengaruh Konfirmasi Positif COVID-19 Kepada Return Pasar Saham pada objek emiten yang terdaftar pada di Bursa Efek Indonesia, Malaysia, Singapura, Thailand, dan Vietnam..... | 69 |
| 4.6.3 | Pengaruh Konfirmasi Kematian COVID-19 Kepada Return Pasar Saham pada objek emiten yang terdaftar pada di Bursa Efek Indonesia, Malaysia, Singapura, Thailand, dan Vietnam..... | 69 |
| 4.6.4 | Pengaruh Vaksinasi COVID-19 Kepada Return Pasar Saham pada objek emiten yang terdaftar pada di Bursa Efek Indonesia, Malaysia, Singapura, Thailand, dan Vietnam..... | 70 |
| 4.6.5 | Peran Nilai Tukar Sebagai Variabel Kontrol..... | 70 |
| BAB V PENUTUP | | 72 |
| 5.1 | Kesimpulan..... | 72 |
| 5.2 | Implikasi Teoritis..... | 73 |
| 5.3 | Implikasi Manajerial | 75 |
| 5.4 | Implikasi Kebijakan | 75 |

| | | |
|-----------------------------|---|-----------|
| 5.5 | Limitasi | 76 |
| 5.6 | Agenda Penelitian Yang Akan Datang | 76 |
| DAFTAR PUSTAKA | | 77 |
| LAMPIRAN | | 80 |

