

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Sertifikasi	ii
Pengesahan Tesis	iii
Motto dan Persembahan	iv
<i>Abstract</i>	v
Abstrak	vi
Kata Pengantar	vii
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel	xiii
Daftar Gambar	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	12
1.3. Tujuan Penelitian	13
1.4. Manfaat Penelitian	14
1.5. Sistematika Penulisan	15
BAB II TELAAH PUSTAKA	17

2.1. Landasan Teori	17
2.1.1. Hipotesis Efisiensi Pasar	17
2.1.2. Teori Sinyal.....	19
2.1.3. <i>Return</i> Pasar Saham	20
2.1.4. Kasus Konfirmasi dan Kasus Meninggal Akibat Covid-19	21
2.1.5. Kapitalisasi Pasar	22
2.1.6. <i>Price to Book Value</i>	22
2.2. Penelitian Terdahulu	24
2.3. Hubungan antar variabel dan Hipotesis Penelitian	32
2.3.1. Pertumbuhan kasus konfirmasi dan <i>return</i> pasar saham	32
2.3.2. Pertumbuhan kasus meninggal dan <i>return</i> pasar saham.....	33
2.3.3. Kapitalisasi pasar sebagai variabel kontrol	35
2.3.4. <i>Price to book value</i> sebagai variabel kontrol	36
2.4. Perumusan Hipotesis dan Kerangka Pemikiran Teoritis	37
BAB III METODE PENELITIAN	40
3.1. Jenis dan Sumber Data	40
3.2. Populasi, Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel	40
3.2.1. Populasi Penelitian	40
3.2.2. Sampel Penelitian	41
3.2.3. Teknik Pengambilan Sampel	43

3.3. Definisi Operasional Variabel	44
3.3.1. Variabel Dependen	44
3.3.2. Variabel Independen	45
3.3.3. Variabel Kontrol	45
3.4. Metode Pengumpulan Data	46
3.5. Teknik Analisis Data	47
BAB IV ANALISIS DATA	50
4.1. Data Penelitian	50
4.2. Hasil Penelitian	50
4.2.1. Statistik Deskriptif	50
4.2.2. Uji Multikolinieritas	52
4.2.3. Uji Heteroskedastisitas	53
4.2.4. Uji Signifikansi Variabel Kontrol	54
4.2.5. Analisis Regresi Berganda Model Pertama	55
4.2.5.1. Uji Koefisien Determinasi Model Pertama..	55
4.2.5.2. Uji F-Statistik Model Pertama	56
4.2.5.3. Uji t-Statistik Model Pertama.....	57
4.2.6. Analisis Regresi Berganda Model Kedua	58
4.2.6.1. Uji Koefisien Determinasi Model Kedua....	58
4.2.6.2. Uji F-Statistik Model Kedua	59
4.2.6.3. Uji t-Statistik Model Kedua	60
4.3. Pembahasan	62
4.3.1. Pengaruh Jumlah Kasus konfirmasi Covid-19	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1. <i>Research Gap</i> Pengaruh Jumlah Kasus Konfirmasi dan Jumlah Kasus Meninggal Akibat Covid-19 terhadap <i>Return Saham</i>	12
Tabel 2.1. Penelitian Terdahulu	24
Tabel 3.1. Sumber Data Variabel Penelitian	40
Tabel 3.2. Proses Seleksi Sampel Penelitian.....	41
Tabel 3.3. Data Sampel Penelitian	42
Tabel 3.4. Definisi Operasional Variabel	46
Tabel 4.1. Statistik Deskriptif	52
Tabel 4.2. Uji Multikolinieritas	53
Tabel 4.3. Uji Heteroskedastisitas	54
Tabel 4.4. Uji Signifikansi Variabel Kontrol	55
Tabel 4.5. Koefisien Determinasi Model Pertama.....	55
Tabel 4.6. Uji F-Statistik Model Pertama	56
Tabel 4.7. Uji t-Statistik Model Pertama	57
Tabel 4.8. Koefisien Determinasi Model Kedua	75
Tabel 4.9. Uji F-Statistik Model Kedua	60
Tabel 4.10. Uji t-Statistik Model Kedua	61
Tabel 4.11. Uji t- Statistik Model Regresi Pertama dan Kedua	64
Tabel 4.12. Ringkasan Hasil Pengujian dengan Variabel Kontrol	68

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Grafik 10 Negara Terdampak Virus Corona	3
Gambar 1.2. Grafik Kasus Konfirmasi Covid-19 di Asia Tenggara.....	4
Gambar 1.3. Grafik Kasus Meninggal Akibat Covid-19 di Asia	5
Gambar 1.4. Harga Saham <i>Jakarta Stock Industrial Classification</i> (JASICA) Tahun 2020	6
Gambar 1.5. Grafik Kasus Konfirmasi Covid-19 dan <i>Return Saham</i> Indeks LQ45	9
Gambar 1.6. Grafik Kasus Meninggal Akibat Covid-19 dan <i>Return Saham</i> Indeks LQ45	10
Gambar 2.1. Kerangka Pemikiran Teoritis	39
Gambar 3.1. Proses Analisis Data	48
Gambar 4.1. Ringkasan Hasil Penelitian Model Regresi Pertama	58
Gambar 4.2. Ringkasan Hasil Penelitian Model Regresi Kedua	62

FEB UNDIP