

## 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
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
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
<b>BAB II TELAAH PUSTAKA .....</b>	<b>17</b>

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
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>40</b>
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
<b>BAB IV ANALISIS DATA .....</b>	<b>50</b>
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