

Daftar Isi

Halaman Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis	iii
Kata Pengantar	iv
Lembar Persembahan	v
Daftar Isi	vii
Daftar Tabel	ix
Daftar Gambar	x
Daftar Lampiran	xi
Intisari	xii
<i>Abstract</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	6
1.6 Sistematika Penulisan	6

BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Landasan Teori	8
2.1.1 Pasar Modal	8
2.1.2 <i>Return Saham</i>	9
2.1.3 Indeks LQ45	11
2.1.4 Hipotesis Pasar Efisien	12
2.1.5 Efek Pandemi.....	14
2.1.6 Kapitalisasi Pasar.....	16
2.1.7 Rasio <i>Market to book</i>	18
2.1.8 Sektor Industri	18
2.1.9 Analisis Industri	21
2.2 Hipotesis Penelitian	23
 BAB III METODE PENELITIAN	 25
3.1 Desain Penelitian	25
3.2 Sampel Penelitian yang Digunakan	27
3.3 Jenis Data dan Metode Pengambilan Data	27
3.4 Definisi Operasional	28
3.4.1 <i>Return Saham</i>	28
3.4.2 Pertumbuhan Kasus Harian Covid-19	29
3.5 Teknis Analisis Data	30
3.5.1 Analisis Regresi Sederhana	30
3.5.1.1 Model Analisis Regresi	31
3.5.1.2 Pengujian Model Regresi Data Panel	32
3.5.2 Uji Asumsi Klasik	36
3.5.2.1 Uji Normalitas	36
3.5.2.2 Uji Autokorelasi	36
3.5.2.3 Uji Heteroskedastisitas	37
3.6 Uji Hipotesis	37

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	38
4.1 Hasil Pengumpulan Data	38
4.2 Statistika Deskriptif	38
4.3 Hasil Pengolahan Data	46
4.3.1 Pengaruh Pertumbuhan Kasus Positif terhadap <i>Return</i>	46
4.3.1.1 Penentuan Model Regresi Data Panel	46
4.3.1.2 Uji Asumsi Klasik	48
4.3.2 Pengaruh Pertumbuhan Kasus Kematian terhadap <i>Return</i>	49
4.3.2.1 Penentuan Model Regresi Data Panel	49
4.3.2.2 Uji Asumsi Klasik	51
4.4 Hasil Uji Hipotesis	52
4.5 Diskusi	57
 BAB V PENUTUP	 58
5.1 Kesimpulan	58
5.2 Keterbatasan Penelitian	59
5.3 Saran dan Rekomendasi	59
 Daftar Pustaka	 60
 Lampiran	 64