

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN .....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>iv</b>
<b>DAFTAR ISI .....</b>	<b>v</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>x</b>
<b>INTISARI .....</b>	<b>xi</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	3
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	5
1.4 Tujuan Penelitian .....	5
1.5 Motivasi Penelitian .....	6
1.6 Manfaat Penelitian .....	6
1.7 Kontribusi Penelitian .....	6
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian .....	7
1.9 Sistematika Penulisan .....	7
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>8</b>
2.1 Landasan Teori .....	8
2.1.1 Teori Sinyal ( <i>Signaling Theory</i> ).....	8
2.1.2 Teori Prospek ( <i>Prospect Theory</i> ) .....	8
2.2 Tinjauan Penelitian .....	10
2.2.1 Studi Literatur Pandemi Covid-19 dan Kasus Positif Harian.....	10
2.2.2 Studi Literatur Indeks Harga Saham dan Kasus Kematian .....	10
2.2.3 Studi Literatur Hubungan Indeks Harga Saham dan Atensi Investor ...	11
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>13</b>

3.1 Desain Penelitian.....	13
3.2 Definisi Operasional Variabel .....	13
3.2.1. Indeks Harga Saham Gabungan .....	14
3.2.2 Indeks Harga Saham Sektoral .....	14
3.2.3 Kasus Konfirmasi Positif Baru Harian .....	14
3.2.4 Kasus Kematian Baru Harian .....	15
3.2.5 <i>Google Search Volume</i> (GSV) .....	16
3.2.6 Indeks Keketatan Respons Pemerintah.....	17
3.2.7 Kurs Nominal Rupiah terhadap Dolar .....	18
3.2.8 <i>Indonesia Overnight Index Average</i> .....	18
3.2.9 Harga Emas Berjangka .....	19
3.2.10 Vaksinasi Harian per-100 Orang.....	19
3.3 Teknik Pengumpulan Data .....	19
3.4 Teknik Analisis Data.....	20
3.4.1 Uji Akar Unit.....	21
3.4.2 Penentuan Spesifikasi Model .....	22
3.4.3 Model ARDL.....	22
3.4.4 Uji Kointegrasi Panjang Model NARDL .....	23
3.4.5 Error Correction Model (ECM).....	25
3.4.6 Uji Diagnostik .....	26
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>28</b>
4.1 Statistik Deskriptif .....	28
4.2 Hasil Pengujian dan Pembahasan.....	33
4.2.1 Uji Akar Unit.....	33
4.2.2 Penentuan Spesifikasi Model NARDL .....	35
4.2.3 Hasil Estimasi Jangka Panjang .....	36
4.2.4 Hasil Estimasi Jangka Pendek .....	55
4.2.5 Uji Diagnostik Residual Model NARDL .....	58
4.2.6 Uji Spesifikasi Model .....	60
4.2.7 Uji Stabilitas .....	61
<b>BAB V SIMPULAN .....</b>	<b>65</b>
5.1 Simpulan .....	65

5.2 Keterbatasan .....	67
5.3 Implikasi .....	68
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>69</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>	<b>75</b>
Lampiran 1. Hasil Uji Akar Unit .....	75
Lampiran 2. Hasil Spesifikasi Model dan <i>Lag</i> .....	100
Lampiran 3. Hasil Long Run Form and Bounds Test .....	104
Lampiran 4. Hasil Uji Error Correction Model (ECM) .....	111
Lampiran 5. Uji Diagnostik Serial Korelasi .....	118
Lampiran 6. Uji Diagnostik Heteroskedastisitas .....	125
Lampiran 7. Uji Spesifikasi Model .....	132