

Daftar isi

Halaman Judul.....	i
Halaman pengesahan.....	ii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	viii
Daftar Grafik.....	ix
Daftar Gambar.....	x
Daftar Lampiran.....	xii
Daftar Istilah.....	xiii
Intisari.....	xiv
<i>Abstract</i>	xv
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	7
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Motivasi Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
1.7 Kontribusi Penelitian.....	9
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	10
1.9 Sistematika Penulisan.....	11
BAB II. LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA.....	13
2.1 Landasan Teori.....	13
2.1.1 Indeks Saham.....	13
2.1.2 Volatilitas Pasar.....	14
2.1.3 Behavioral Finance.....	15
2.1.4 Sentimen Investor.....	18
2.1.5 <i>Coronavirus Disease 2019 (COVID-19)</i>	20
2.2 Tinjauan Pustaka.....	22

2.3 Pengembangan Hipotesis.....	27
BAB III. METODE PENELITIAN.....	28
3.1 Desain Penelitian.....	28
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	29
3.3 Populasi dan Sampel.....	30
3.4 Instrumen Penelitian.....	31
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	32
3.6 Teknik Analisis Data.....	33
3.7 Uji Asumsi Klasik.....	35
BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	37
4.1 Deskripsi Data.....	37
4.2 Hasil Pengujian Data.....	39
4.2.1 Uji Normalitas.....	39
4.2.2 Uji Heteroskedastisitas.....	42
4.2.3 Uji Multikoleniaritas.....	47
4.3 Uji Hipotesis.....	54
4.4 Implikasi Hasil Penelitian.....	66
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN.....	67
5.1 Kesimpulan.....	67
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	68
5.3 Saran dan Rekomendasi.....	69
Daftar Pustaka.....	70
Lampiran.....	73

Daftar Tabel

4.1	Statistik Deskriptif <i>Return</i> IHSG, LQ45, PEFINDO25, Sri-Kehati dan Syariah.....	37
-----	---	----

Daftar Grafik

4.1	Grafik Plot Probabilitas Normal <i>Return</i> IHSG.....	39
4.2	Grafik Plot Probabilitas Normal <i>Return</i> PEFINDO25.....	40
4.3	Grafik Plot Probabilitas Normal <i>Return</i> LQ45.....	40
4.4	Grafik Plot Probabilitas Normal <i>Return</i> Sri-Kehati.....	41
4.5	Grafik Plot Probabilitas Normal <i>Return</i> Syariah.....	41

Daftar Gambar

4.1	Uji Heteroskendastisitas pada model 1 (IHSG).....	42
4.2	Uji Heteroskendastisitas pada model 2 (IHSG).....	42
4.3	Uji Heteroskendastisitas pada model 3 (IHSG).....	43
4.4	Uji Heteroskendastisitas pada model 1 (PEFINDO25).....	43
4.5	Uji Heteroskendastisitas pada model 2 (PEFINDO25).....	43
4.6	Uji Heteroskendastisitas pada model 3 (PEFINDO25).....	44
4.7	Uji Heteroskendastisitas pada model 1 (LQ45).....	44
4.8	Uji Heteroskendastisitas pada model 2 (LQ45).....	45
4.9	Uji Heteroskendastisitas pada model 3 (LQ45).....	45
4.10	Uji Heteroskendastisitas pada model 1 (SRI-KEHATI).....	46
4.11	Uji Heteroskendastisitas pada model 2 (SRI-KEHATI).....	46
4.12	Uji Heteroskendastisitas pada model 3 (SRI-KEHATI).....	46
4.13	Uji Heteroskendastisitas pada model 1 (Syariah).....	47
4.14	Uji Heteroskendastisitas pada model 2 (Syariah).....	47
4.15	Uji Heteroskendastisitas pada model 3 (Syariah).....	47
4.16	Uji Multikolinearitas pada model 1 (IHSG).....	48
4.17	Uji Multikolinearitas pada model 2 (IHSG).....	48
4.18	Uji Multikolinearitas pada model 3 (IHSG).....	49
4.19	Uji Multikolinearitas pada model 1(PEFINDO25).....	49
4.20	Uji Multikolinearitas pada model 2 (PEFINDO25).....	50
4.21	Uji Multikolinearitas pada model 3 (PEFINDO25).....	50
4.22	Uji Multikolinearitas pada model 1 (LQ45).....	51

4.23	Uji Multikolinearitas pada model 2 (LQ45).....	51
4.24	Uji Multikolinearitas pada model 3 (LQ45).....	51
4.25	Uji Multikolinearitas pada model 1 (SRI-KEHATI).....	52
4.26	Uji Multikolinearitas pada model 2 (SRI-KEHATI).....	52
4.27	Uji Multikolinearitas pada model 3 (SRI-KEHATI).....	53
4.28	Uji Multikolinearitas pada model 1 (Syariah).....	53
4.29	Uji Multikolinearitas pada model 2 (Syariah).....	54
4.30	Uji Multikolinearitas pada model 3 (Syariah).....	54
4.31	Regresi Linear pada model 1 (IHSG).....	55
4.32	Regresi Linear pada model 2 (IHSG).....	56
4.33	Regresi Linear pada model 3 (IHSG).....	56
4.34	Regresi Linear pada model 1 (PEFINDO25).....	57
4.35	Regresi Linear pada model 2 (PEFINDO25).....	58
4.36	Regresi Linear pada model 3 (PEFINDO25).....	58
4.37	Regresi Linear pada model 1 (LQ45).....	59
4.38	Regresi Linear pada model 2 (LQ45).....	60
4.39	Regresi Linear pada model 3 (LQ45).....	60
4.40	Regresi Linear pada model 1 (SRI-KEHATI).....	61
4.41	Regresi Linear pada model 2 (SRI-KEHATI).....	62
4.42	Regresi Linear pada model 3 (SRI-KEHATI).....	62
4.43	Regresi Linear pada model 1 (Syariah).....	64
4.44	Regresi Linear pada model 2 (Syariah).....	64
4.45	Regresi Linear pada model 3 (Syariah).....	64

Daftar Lampiran

- 1 DATA INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN
- 2 DATA INDEKS PEFINDO25
- 3 DATA INDEKS LQ45
- 4 DATA INDEKS SRI-KEHATI
- 5 DATA INDEKS SYARIAH

Daftar Istilah

BEI	Bursa Efek Indonesia
COVID-19	<i>Corona Virus Disease 2019</i>
EMH	<i>Efficient Market Hypothesis</i>
IHSG	Indeks Harga Saham Gabungan
SARS-CoV-2	<i>Severe acute respiratory syndrome coronavirus 2</i>
WHO	<i>World Health Organization</i>