

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR GRAFIK.....	ix
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah.....	5
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	6
1.4. Tujuan Penelitian	6
1.5. Manfaat Penelitian	7
1.6. Lingkup Penelitian	7
1.7. Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI.....	9
2.1. Landasan Teori.....	9
2.1.1. <i>Behavioral Finance</i>	9
2.1.1.1. <i>Limits to Arbitrage</i>	9
2.1.1.2. Psikologi Kognitif dalam Pengambilan Keputusan	11
2.1.1.3. <i>Disposition Effect Theory</i>	12
2.1.1.4. Teori Perhatian yang Terbatas	16
2.1.2. Sentimen Investor	17



2.1.2.1. Google SVI Sebagai Proxi Sentimen Investor.....	19
2.1.2.2. Sentimen Investor dan Likuiditas Saham	23
2.1.2.3. Sentimen Investor dan <i>Return</i> Saham.....	27
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	28
2.3. Perumusan Hipotesis.....	30
2.4. Model Penelitian	32
BAB III METODE PENELITIAN.....	33
3.1. Desain Penelitian	33
3.2. Metode Pengumpulan Data.....	33
3.2.1. Populasi dan Sampel Penelitian	33
3.2.2. Jenis, Sumber, dan Metode Pengumpulan Data Penelitian.....	33
3.3. Instrumen Penelitian	34
3.3.1. Sentimen Covid-19 (Sent Covid).....	35
3.3.2. Likuiditas IHSG (<i>Turnover</i> IHSG)	37
3.3.3. <i>Return</i> IHSG	38
3.3.4. Variabel Kontrol	38
3.3.5. Pra-Pengolahan Data.....	40
3.4. Metode Analisis Data.....	41
3.4.1. Analisis Statistik Deskriptif	41
3.4.2 Analisis Regresi Linear Berganda	41
3.4.2.1. Uji Stasioneritas Data	41
3.4.2.2. Uji Asumsi Klasik.....	42
3.4.2.3. Uji Hipotesis	44
3.4.3. Wilcoxon <i>Signed-Rank Test</i> untuk Dua Sampel Berhubungan	47
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	49
4.1. Analisis Statistik Deskriptif	50
4.2. Penyusunan Sentimen Covid-19.....	51



4.3. Uji Akar Unit Variabel Regresi	53
4.4. Pengaruh Sentimen Covid Terhadap Likuiditas IHSG	54
4.4.1. Uji Asumsi Klasik.....	54
4.4.2. Uji Hipotesis	55
4.5. Pengaruh Sentimen Covid Terhadap <i>Return</i> IHSG	56
4.5.1. Uji Asumsi Klasik.....	56
4.5.2. Uji Hipotesis	57
4.6. Perbedaan Likuiditas IHSG Sebelum dan Selama Pandemi Covid-19.....	60
4.6.1. Uji Normalitas.....	60
4.6.2. Wilcoxon <i>Signed-rank</i> Test untuk Dua Sampel Berhubungan	60
4.7. Pembahasan.....	62
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	65
5.1. Kesimpulan	65
5.2. Implikasi	65
5.1. Keterbatasan Penelitian.....	66
5.1. Saran	66
DAFTAR PUSTAKA	68