

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TUGAS AKHIR	i
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR	ii
PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR.....	iii
PERNYATAAN DAN PERSETUJUAN UNGGAH TUGAS AKHIR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	8
1.5 Batasan Penelitian	9
1.6 Sistematika Penulisan	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11

2.1 Landasan Teori.....	11
2.1.1 Saham.....	11
2.1.2 Bank	12
2.1.3 Return Saham	13
2.1.4 Likuiditas	14
2.1.5 Ukuran.....	15
2.1.6 Modal	15
2.1.7 Kepemilikan Institusional	17
2.1.8 Tipe Bank.....	18
2.2 Penelitian Terdahulu	19
2.3 Kerangka Pemikiran.....	26
2.4 Hipotesis Penelitian.....	27
2.4.1 Pengaruh Pandemi Covid- 19 terhadap Kinerja Saham Bank	27
2.4.2 Pengaruh Likuiditas terhadap Kinerja Saham Bank Pada Masa Krisis	30
2.4.3 Pengaruh Ukuran terhadap Kinerja Saham Bank Pada Masa Krisis.....	33
2.4.4 Pengaruh Modal terhadap Kinerja Saham Bank Pada Masa Krisis	35
2.4.5 Pengaruh Kepemilikan Institusional terhadap Kinerja Saham Bank Pada Masa Krisis	37
2.4.6 Pengaruh Tipe Bank terhadap Kinerja Saham Bank Pada Masa Krisis.....	40
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	41
3.1 Data.....	41
3.2 Model Penelitian	42
3.3 Model Panel	46
3.3.1 Common Effect Model / Pooled Least Square.....	46
3.3.2 Fixed Effect Model	47
3.3.3 Random Effect Model	47
3.4. Pemilihan Panel Model	48
3.4.1 Chow Test	48

3.4.2 Langrage Multiplier Test	48
3.4.3 Hausman Test.....	49
3.5 Pegujian Asumsi Klasik dalam Model Panel	50
3.5.1 Uji Heteroskedastisitas	50
3.5.2 Uji Otokorelasi – Wooldridge test	51
3.5.3 Uji Cross Dependency – Pesaran Test	52
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	53
4.1 Statistik Deskriptif	53
4.2 Analisis Data	56
4.2.1 Hasil Uji Ketepatan Model	56
4.2.1.1 Hasil Uji Chow.....	56
4.2.1.2 Hasil Uji Langrage Multiplier.....	57
4.2.2 Hasil Uji Asumsi Klasik	59
4.2.2.1 Uji Multikolinearitas	59
4.2.2.2 Hasil Uji Heteroskedastisitas	60
4.2.2.3 Hasil Uji Otokorelasi	61
4.2.2.4 Hasil Uji Cross-sectional Dependence.....	62
4.3 Hasil Uji Hipotesis	63
4.4 Pembahasan Hasil	67
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	76
5.1 Kesimpulan	76
5.2 Saran Penelitian.....	78
DAFTAR PUSTAKA	80
LAMPIRAN.....	85

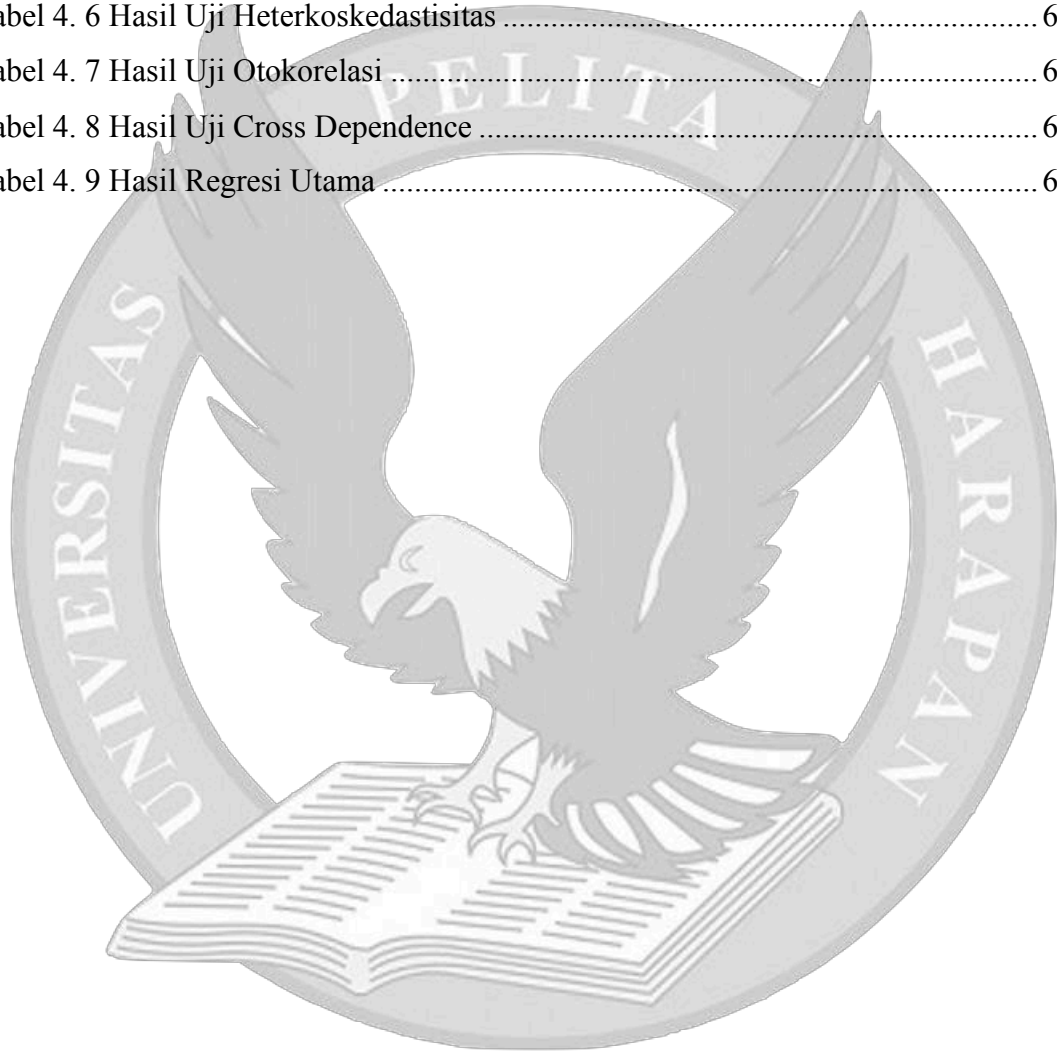
DAFTAR GAMBAR

Gambar 2. 1 Kerangka Pemikiran.....27



DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1 Statistik Deskriptif	53
Tabel 4. 2 Hasil Uji Chow	56
Tabel 4. 3 Hasil Uji Langrage Multiplier	57
Tabel 4. 4 Hasil Uji Hausman	58
Tabel 4. 5 Hasil Uji Multikolinearitas	59
Tabel 4. 6 Hasil Uji Heterkoskedastisitas	60
Tabel 4. 7 Hasil Uji Otokorelasi	61
Tabel 4. 8 Hasil Uji Cross Dependence	62
Tabel 4. 9 Hasil Regresi Utama	63



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Hasil Pengolahan Data STATA (Sebelum Winsorizing)	85
Lampiran 2 Hasil Pengolahan Data STATA (Setelah Winsorizing)	91

