

KATA PENGANTAR

Puji dan syukur kepada Tuhan yang Maha Esa atas berkat penyertaan-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan tugas akhir ini, sebagai salah satu syarat akademik guna menyelesaikan pendidikan jenjang Strata dua Jurusan Manajemen Investasi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Pelita Harapan Jakarta.

Penulis berharap laporan hasil tugas akhir ini dapat menjadi tambahan pengetahuan dalam bidang ekonomi dan bisnis, bagi mahasiswa umumnya dan bagi penulis khususnya.

Dengan selesainya laporan tugas akhir ini tidak lupa penulis sampaikan terimakasih kepada semua pihak yang telah membantu dalam menyusun laporan ini sehingga dapat diselesaikan dengan baik, khususnya kepada :

1. Dra. Gracia Shinta S. Ugut, M.B.A, Ph.D selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Pelita Harapan
2. Dr. Innocentius Bernarto selaku Ketua Program Studi Magister Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Pelita Harapan
3. Dr. Kim Sung Suk, BA. M.Sc. selaku Dosen Pembimbing yang telah dengan sabar dan penuh perhatian membimbing dan mengarahkan penulis selama proses penulisan tesis.
4. Dosen dan Staff pengajar dalam program studi Magister Manajemen Universitas Pelita Harapan atas ilmu, pengalaman, saran, bimbingan, dan bantuan yang telah diberikan selama masa perkuliahan hingga tesis ini dapat selesai dengan baik.
5. Staf Karyawan Administrasi Program Studi Magister Manajemen yang telah membantu penulis dalam kegiatan administratif, khususnya Pak Joko

yang sudah sangat banyak membantu kami dari awal perkuliahan hingga akhir penulisan thesis ini.

6. Papa Albertus Yohanes Winarto dan Mama Tina Ratnawati Safawan yang telah sangat berkontribusi dalam memberikan doa, dukungan, semangat dan perhatian selama proses pengerjaan tesis ini.
7. Teman-teman program studi Magister Manajemen Universitas Pelita Harapan angkatan MM 82A, yang telah menemani dan mendukung penulis selama menjalankan perkuliahan di Universitas Pelita Harapan dan memberikan doanya kepada penulis dalam menyelesaikan Tugas Akhir ini, sukses untuk kita semua.
8. Semua pihak yang namanya tidak dapat disebutkan satu per satu yang telah membantu selama pembuatan laporan hasil tugas akhir ini.

Penulis sadar bahwa penulisan tesis ini masih jauh dari sempurna. Untuk itu penulis sangat mengharapkan saran dan kritik yang membangun.

Pada akhirnya penulis berharap semoga laporan tugas akhir ini dapat bermanfaat bagi semua pihak yang berkepentingan.

Jakarta, 4 Januari 2021

¹ Amelia Yosephine_01619190028

² Anastasia Yuanita_01619190029

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pernyataan Keaslian Karya Tugas Akhir.....	ii
Halaman Persetujuan Dosen Pembimbing Tugas Akhir.....	iii
Halaman Persetujuan Tim Penguji Tugas Akhir.....	iv
Abstrak.....	v
Kata Pengantar.....	vi
Daftar Isi	viii
Daftar Gambar.....	xi
Daftar Tabel	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	3
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	4
1.5 Pembatasan Masalah	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Peristiwa Bencana Alam dan Pasar Saham	6

2.2	Pandemi dan Pasar Saham.....	9
2.2.1	Pandemi Ebola dan Pasar Saham.....	10
2.2.2	Pandemi Flu dan Pasar Saham	11
2.2.3	Pandemi Severe Acute Respiratory Syndrome (SARS) dan Pasar Saham	11
2.2.4	Pandemi COVID-19 dan Pasar Saham.....	12
2.3	Intervensi Pemerintah dan Pasar Saham	16
2.4	Pengajuan Hipotesis	17

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Data	19
3.2	Model Empiris.....	19
3.3	Variabel Penelitian.....	20
3.3.1	Variabel Dependen.....	20
3.3.2	Variabel Independen	21
3.4	Metode Analisis.....	21
3.5	Uji Asumsi Klasik	22
3.5.1	Uji Autokorelasi	22
3.5.2	Uji Heteroskedastisitas	22

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1	Analisis Deskripsi Statistik	24
4.1.1	Analisis Deskriptif Statistik Industri	28
4.2	Asumsi Klasik	31
4.2.1	Uji Autokorelasi	31
4.2.1.1	Uji Autokorelasi Untuk Analisa Industri	32
4.2.2	Uji Heteroskedastisitas	33
4.2.2.1	Uji Heteroskedastisitas Untuk Analisa Industri	34
4.3	Hasil Empiris dan Pembahasan	35
4.4	Analisa Industri	38

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1	Kesimpulan.....	48
5.2	Saran.....	49

DAFTAR PUSTAKA

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1 Data Harian Kasus Terkonfirmasi COVID-19..... 26

Gambar 4.2 Data Harian Kasus Kematian terkait COVID-19..... 27



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Deskriptif Statistik	24
Tabel 4.1.1	Deskriptif Statistik Industri.....	28
Tabel 4.2	Hasil Uji <i>Durbin Watson</i>	32
Tabel 4.2.1	Hasil Uji <i>Durbin Watson</i> Untuk Analisa Industri.....	32
Tabel 4.3	Hasil Uji <i>Breusch Pagan Godfrey</i>	33
Tabel 4.3.1	Hasil Uji <i>Breusch Pagan Godfrey</i> Untuk Analisa Industri	34
Tabel 4.4	Hasil Regresi Model Pertumbuhan Harian Kasus dan Kematian COVID-19	35
Tabel 4.5.1	Hasil Regresi Industri Agrikultur	38
Tabel 4.5.2	Hasil Regresi Industri Keuangan	39
Tabel 4.5.3	Hasil Regresi Industri Perdagangan	40
Tabel 4.5.4	Hasil Regresi Industri Properti.....	41
Tabel 4.5.5	Hasil Regresi Industri Pertambangan.....	42
Tabel 4.5.6	Hasil Regresi Industri Dasar	42
Tabel 4.5.7	Hasil Regresi Industri Lain-Lain.....	43
Tabel 4.5.8	Hasil Regresi Industri Produk Konsumsi	44
Tabel 4.5.9	Hasil Regresi Industri Produk Infrastruktur.....	45