

KATA PENGANTAR

Penulis memanjatkan puji syukur kepada Tuhan Yang Maha Esa atas segala berkat yang telah diberikan-Nya sehingga dapat menyelesaikan proses penulisan skripsi ini dengan judul “Indeks Pandemi dan Pengembalian Saham di Indonesia”. Skripsi ini disusun untuk memenuhi sebagian persyaratan akademi kelulusan agar dapat memperoleh Gelar Sarjana Ekonomi S1 dari Universitas Pelita Harapan.

Sebagai ungkapan apresiasi untuk dukungan moral dan bimbingan sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi tepat pada waktunya maka penulis mengucapkan terima kasih sebesar-besarnya kepada:

1. Ibu Dra. Gracia S. S. Ugut, MBA., Ph.D., selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis.
2. Ibu Vina Christina Nugroho, S.E., M.M., selaku Ketua Program Studi Manajemen.
3. Ibu Liza Handoko, S.E., M.M., selaku dosen pembimbing saya yang pada semester ini telah rela menyisihkan waktunya untuk dapat membimbing saya dari awal sampai akhir untuk proses pembuatan skripsi serta memberikan bantuan dan masukan jika terdapat kesalahan.
4. Bapak Dr. Kim Sung Suk, B.A., M.Sc., selaku Ketua Konsentrasi Keuangan yang selama saya menempuh perkuliahan pada konsentrasi keuangan telah memberikan saya banyak sekali wawasan serta membantu saya dalam menyusun data yang diperlukan untuk menyelesaikan penelitian.

5. Bapak Dr. Drs. John Tampil Purba, M.M., selaku dosen pembimbing akademik saya yang selama saya menempuh perkuliahan telah membimbing saya dalam berbagai perihal akademik dan telah menyetujui proses penulisan skripsi.
6. Semua dosen yang selama masa perkuliahan saya di Universitas Pelita Harapan telah mendidik saya dan mengajarkan saya mengenai banyak hal.
7. Orang tua saya yang selama ini telah mendukung, memberikan bantuan moral dan menyemangati saya agar saya dapat menyelesaikan penulisan skripsi ini.
8. Teman-teman saya yang semenjak saya berkuliah di Universitas Pelita Harapan telah mendukung saya dan mendorong saya agar saya dapat menyelesaikan penulisan skripsi tepat pada waktunya.
9. Semua pihak lainnya yang namanya tidak dapat saya sebutkan satu per satu.

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSYARATAN KEASLIAN TUGAS AKHIR	ii
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING	iii
PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Permasalahan Penelitian	4
1.3 Tujuan Penelitian	4
1.4 Manfaat Penelitian	4
BAB II LANDASAN TEORI	6
2.1 Pandemi dan Dampaknya Pada Pasar Finansial	7
2.2 Perilaku Investor dan Pandemi	21
2.3 Hipotesis Penelitian	28
BAB III DATA DAN METODOLOGI PENELITIAN	29
3.1 Sampel	29
3.2 Data Penelitian	30
3.3 Operasionalisasi Variabel	32
3.4 Model Penelitian	33

3.5 Proses Pengolahan Data	36
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Statistik Deskriptif	39
4.2 Pengujian Diagnostik	39
4.2.1 Heteroskedastisitas	39
4.2.2 Autokorelasi	41
4.3 Pembahasan Hasil	41
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	45
5.1 Kesimpulan	45
5.2 Saran	45
DAFTAR PUSTAKA	46
LAMPIRAN	50



DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.1. Indeks Pandemi dari Tahun 1996-2021	31
Gambar 4.1 Grafik <i>Abnormal Return</i> Portofolio	43



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Tabel Statistik Deskriptif	39
Tabel 4.2. Hasil Pengujian Heteroskedastisitas	40
Tabel 4.3. Hasil Pengujian Autokorelasi	41
Tabel 4.4. Hasil Regresi Akhir	42



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran A	50
Lampiran B	51
Lampiran C	52
Lampiran D	53
Lampiran E	54
Lampiran F	55

