

ABSTRAK

Oswaldo Salim (01011180141)

INDEKS PANDEMI DAN PENGEMBALIAN SAHAM DI INDONESIA

(xii + 55 halaman: 2 gambar; 4 tabel; 6 lampiran)

Tujuan penelitian ini adalah untuk menginvestigasikan pengaruh antara pandemi dengan *return* saham. Untuk menginvestigasi hubungan ini maka akan dilakukan penelitian empiris yang melakukan estimasi dengan cara mengukur pandemi menggunakan indeks pandemi terhadap *excess return* saham.

Analisis hasil regresi berdasarkan tingkat beta pandemi memberikan sugesti bahwa terdapat hubungan negatif antara beta pandemi terhadap *abnormal return*. Hubungan ini berdasarkan pada hasil penelitian di mana portofolio beta pandemi paling rendah telah mengungguli performa dari portofolio beta pandemi tertinggi sebesar 4,48%.

Referensi: 35 (1964 – 2021)