

DAFTAR ISI

PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TUGAS AKHIR	i
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR	ii
PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR.....	iii
ABSTRAK.....	iv
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Perumusan Masalah.....	5
1.3. Tujuan Penelitian	6
1.4. Manfaat Penelitian	6
1.5. Batasan Penelitian.....	7
1.6. Sistematika Penelitian.....	8
TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1. Kinerja Perbankan.....	10
2.1.1. Return.....	12
2.1.2. Teori Black Swan Event	13
2.2. Pengaruh Likuiditas Pada Kinerja Perbankan.....	14
2.3. Pengaruh Capital Pada Kinerja Perbankan	16
2.4. Pengaruh Size Pada Kinerja Perbankan	18
2.5. Pangaruh Kepemilikan Institusional Pada Kinerja Perbankan.....	22
2.7. Pangaruh Vaksin Pada Kinerja Perbankan.....	23
2.9. Kerangka Pemikiran.....	25
BAB III	25
METODOLOGI PENELITIAN.....	26
3.1. Data.....	26
3.2. Pemilihan Model Empiris	27
3.2.1. Common Efect Model (CE)	27

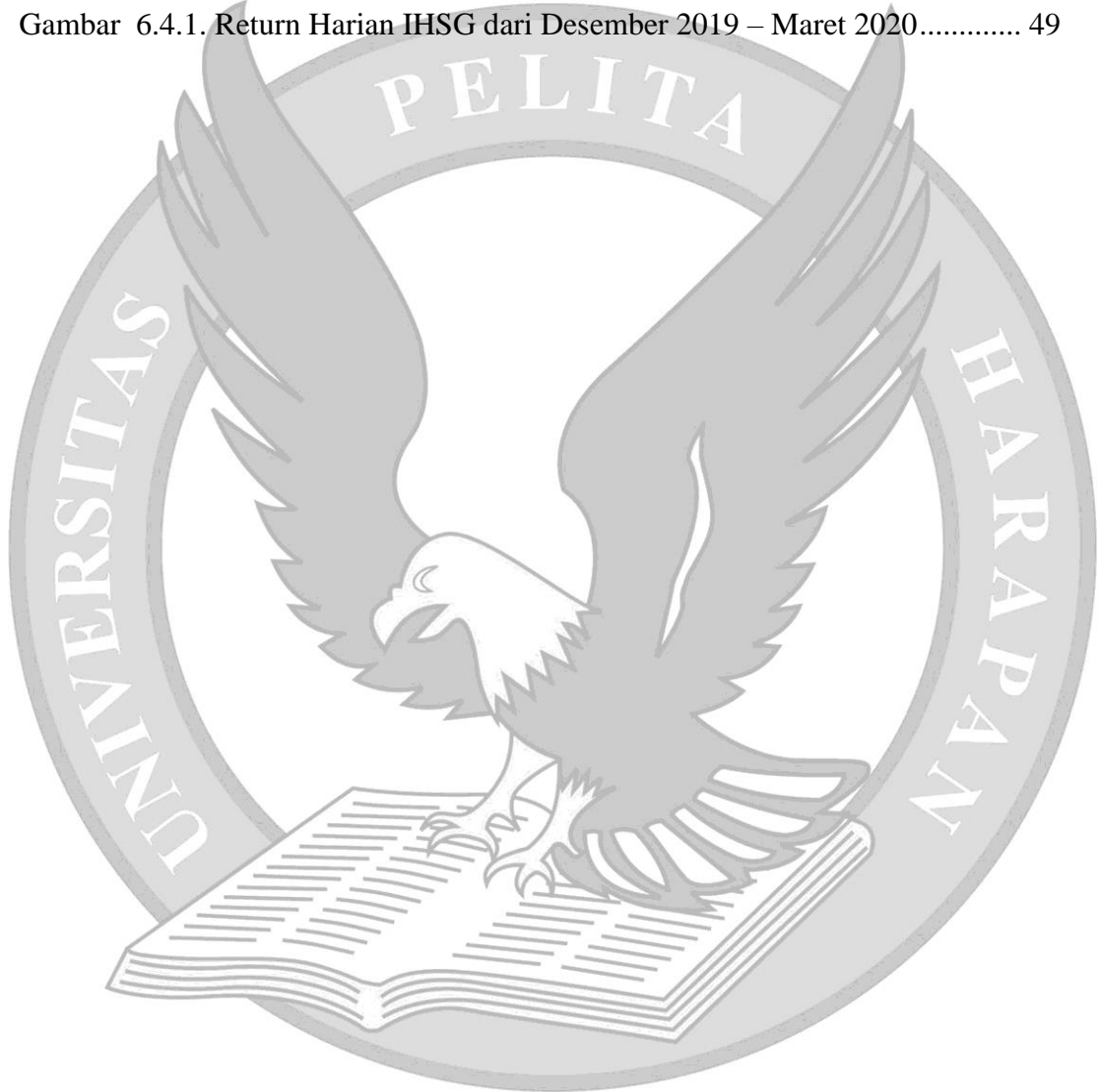
3.2.2.	Fixed Effect Model (FE).....	27
3.2.3.	Random Effect Model (RE).....	28
3.3.	Pengukuran Variabel.....	29
3.4.	Pemilihan Model Panel.....	31
3.4.1.	Uji Chow.....	31
3.4.2.	Uji Langrange Multiplier.....	31
3.4.3.	Uji Hausman.....	32
3.4.6	Uji Heteroskedastisitas.....	33
3.4.6.	Uji Autokorelasi.....	33
3.4.7.	Uji Crossdependency.....	34
BAB IV	35
HASIL DAN PEMBAHASAN	35
4.1.	Analisis Statistik Deskriptif.....	35
4.2	Penentuan Model Panel.....	38
4.2.1.	Hasil Uji Chow.....	39
4.2.2.	Hasil Uji Langrange Multiplier.....	39
4.2.3	Hasil Uji Hausman.....	40
4.3.	Hasil Uji Asumsi Klasik.....	42
4.3.1.	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	42
4.3.2.	Hasil Uji Autokorelasi.....	43
4.3.3.	Hasil Uji Crossdependency.....	43
4.4	Hasil Analisis Regresi.....	44
BAB V	51
KESIMPULAN DAN SARAN	51
5.1.	Kesimpulan.....	51
5.2.	Saran Hasil Penelitian.....	52
DAFTAR PUSTAKA	53
Lampiran I Hasil Pengolahan Data Stata	60
1.	Hasil Regresi Deskriptif Statistik.....	60
2.	Common Effect Model.....	60
3.	Fixed Effect Model.....	61
4.	Randel Effect Model.....	62
5.	Hasil Uji Chow.....	63
6.	Hasil Uji Langrange Multiplier.....	67

7. Hasil Uji Hausman	68
8. Hasil Heteroskedastisitas	68
9. Hasil Autokorelasi	68
10. Hasil Crossdependency	69
11. Hasil Regresi	69
Lampiran II Data Penelitian yang diolah	70



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1.1. Pergerakan IHSG December2019 hingga Maret 2020.....	1
Gambar 2.1.2 Kinerja Sektor IHSG – OJK FSR 2021.....	2
Gambar 3.2.1. Kerangka Pemikiran.....	25
Gambar 4.3.1. Rumus Model Empiris	28
Gambar 5.3.2 Rumus Pengukuran Variabel.....	30
Gambar 6.4.1. Return Harian IHSG dari Desember 2019 – Maret 2020.....	49



DAFTAR TABEL

Tabel 1.3.1. Rumus Pengukuran Variabel	30
Tabel 2.4.1 Analisis Deskriptif	35
Tabel 3.4.2 Chow Test	39
Tabel 4.4.3 Langrange Multiplier Test	40
Tabel 5.4.4 Hausman Test.....	41
Tabel 6.4.5 Kesimpulan Hasil Penentuan Model.....	41
Tabel 7.4.6 Heteroskedastisitas Test.....	42
Tabel 8.4.7 Autokorelasi Test.....	43
Tabel 9.4.8 Crossdependency	44
Tabel 10.4.9 Hasil Uji Hipotesis.....	44

