

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 GAMBER	xii
DAFTAR TABEL	xiii
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Perumusan Masalah	8
1.3. Tujuan Penelitian	9
1.4. Manfaat Penelitian	10
1.5. Batasan Penelitian	11
1.6. Sistematika Penelitian	11
BAB II	13
TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1. Landasan Teori	13
2.1.1. Pengertian Saham	13
2.1.1.1. Jenis Saham dari Segi Kemampuan dalam Hak atau Klaim ...	13
2.1.1.2. Jenis Saham dari Segi Cara Peralihannya	14

2.1.1.3. Jenis Saham dari Segi Kinerja Perdagangan	15
2.1.2. Pandemi Covid 19	16
2.1.3. Return Saham	17
2.1.4. <i>Size</i> Perusahaan	18
2.1.5. Likuiditas Perusahaan	19
2.1.6. <i>Leverage</i> Perusahaan	20
2.1.7. <i>Book Value per Share</i>	21
2.1.8. Profitabilitas	22
2.1.9. <i>Earning Per Share</i>	23
2.1.10. Price Book Value	24
2.2. Penelitian Terdahulu	25
2.3. Kerangka Penelitian	31
2.4. Hipotesis Penelitian	34
2.4.1. Pengaruh Covid-19 Terhadap Kinerja Saham Properti.....	34
2.4.2. Pengaruh <i>Size</i> Terhadap Kinerja Saham Properti	35
2.4.3. Pengaruh <i>CashTa</i> Terhadap Kinerja Saham Properti.....	36
2.4.4. Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap Kinerja Saham Properti	38
2.4.5. Pengaruh <i>BVPS</i> Terhadap Kinerja Saham Properti	39
2.4.6. Pengaruh <i>ROA</i> Terhadap Kinerja Saham Properti	40
2.4.7. Pengaruh <i>EPS</i> Terhadap Kinerja Saham Properti	41
2.4.8. Pengaruh <i>PBV</i> Terhadap Kinerja Saham Properti	42
BAB III	43
3.1. Metode Pengumpulan Data	43
3.2. Populasi dan Pengumpulan Sampel	43

3.3. Teknik Pengumpulan Sampel	44
3.4. Model Panel	45
3.4.1. Common Effect Model / Pooled Least Square	45
3.4.2. Fixed Effect Model (FEM).....	45
3.4.3. Random Effect Model (REM)	46
3.5. Pemilihan Panel Model	46
3.5.1. Chow Test	46
3.5.2. Hausman Test	47
3.5.3. LagRange Multiplier (LM)	48
3.6. Uji Asumsi Klasik	48
3.6.1. Uji Normalitas	49
3.6.2. Uji Multikolinieritas	49
3.6.3. Uji Autokolerasi	50
3.6.3. Uji Heteroskedastisitas	51
3.7. Uji Regresi Berganda	53
3.8. Uji Hipotesis	54
3.8.1. Uji T	54
3.8.2. Uji F	55
BAB IV	56
ANALISA HASIL DAN PEMBAHASAN	59
4.1. Model Deskriptif	59
4.1.1. Hasil Pemilihan Model Panel	60
4.1.1.1. Hasil Uji Chow	60
4.1.1.2. Hasil Uji Hausman Test	60

4.1.1.3. Hasil Uji Lagrange Multiplier (LM)	61
4.1.2. Hasil Uji Asumsi Klasik.....	63
4.1.2.1. Uji Multikolinearitas	63
4.1.2.2 Uji Heteroskedastisitas	64
4.1.2.3 Uji Autokolerasi	64
4.1.2.4 Uji F	65
4.1.2.5 Uji T	66
4.1.2.6 Uji Koefisien Determinasi (R ²)	69
4.2. Pengukuran Model Cumulative Abnormal Return.....	70
4.2.1. Hasil Pembentukan Model	72
4.2.2. Uji Asumsi Klasik	73
4.2.2.1. Uji Normalitas	74
4.2.2.2. Uji Heteroskedastisitas	74
4.2.2.3. Uji Multikolinearitas	75
4.2.3. Uji F	75
4.2.4. Uji T	76
4.2.5. Koefisien Determinasi (R ²)	83
BAB V	84
KESIMPULAN DAN SARAN	84
5.1. Kesimpulan	84
5.2. Saran	86
DAFTAR PUSTAKA	87
Lampiran	96

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. IHSG 2019 - 2020.....	4
Gambar 2.2. Kerangka Penelitian	33
Gambar 4.1 Uji Heteroskedasitas	63
Gambar 4.2. Uji Autokorelasi	64



DAFTAR TABEL

Tabel 1.1. Jumlah Kasus Positif Covid-19	2
Tabel 3.2. Contoh Sampel Perusahaan.	37
Tabel 4.1. Deskriptif Statistik.....	59
Tabel 4.4 Hasil Uji Chow	60
Tabel 4.5 Hasil Uji Hausman.....	61
Tabel 4.6 Hasil Uji Lagrange Multiplier (LM).....	61
Tabel 4.7 Tabel Pemilihan Model Ri	62
Tabel 4.8 Uji Multikolineritas	63
Tabel 4.7 Uji Heteroskedastisitas	64
Tabel 4.8 Uji Autokorelasi	65
Tabel 4.9 Deskriptif Event Window dan Variabel Bebas	70
Tabel 4.9 Hasil Regresi Linear Berganda	72
Tabel 4.10 Uji Normalitas	74
Tabel 4.11 Uji Heteroskedastisitas	74
Tabel 4.12 Uji Multikolinearitas.....	75