

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL LUAR	i
HALAMAN SAMPUL DALAM.....	ii
PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	iii
PENGESAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN.....	v
SURAT PERNYATAAN KESEDIAAN PUBLIKASI.....	vi
MOTTO.....	vii
PERSEMBAHAN	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
ABSTRAK	xvii
ABSTRACT.....	xviii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Identifikasi Masalah dan Batasan Masalah.....	23
C. Rumusan Masalah.....	24
D. Tujuan Penelitian	25
E. Kegunaan Penelitian	27
F. Ruang Lingkup	27
G. Penegasan Variabel	28

H. Sistematika Penulisan	32
BAB II LANDASAN TEORI	34
A. Saham	34
B. <i>Sustainable Development Goals</i> (SDGs).....	43
C. Kapitalisasi Pasar.....	49
D. Kebijakan Dividen	50
E. Kinerja Keuangan	53
F. Hubungan Antar Variabel	56
G. Penelitian Terdahulu	67
H. Kerangka Teori	77
I. Hipotesis Penelitian	78
BAB III METODE PENELITIAN	81
A. Pendekatan dan Jenis Pendekatan.....	81
B. Lokasi Penelitian	82
C. Variabel dan Pengukuran	83
D. Populasi, Sampling, dan Sampel Penelitian	85
E. Instrumen Penelitian	87
F. Teknik Pengumpulan Data.....	87
G. Analisis Data.....	88
BAB IV HASIL PENELITIAN	104
A. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	104
B. Deskripsi Data	115
C. Analisis Data.....	124
BAB V PEMBAHASAN	141

A. Pengaruh <i>Environmental Social Governance</i> (ESG), Kapitalisasi Pasar, <i>Dividend Payout Ratio</i> (DPR), <i>Return on Asset</i> (ROA), <i>Current Ratio</i> (CR), <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) dan <i>Total Asset Turnover</i> (TATO) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	141
B. Pengaruh <i>Environmental Social Governance</i> (ESG) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	143
C. Pengaruh Kapitalisasi Pasar terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	145
D. Pengaruh <i>Dividend Payout Ratio</i> (DPR) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	147
E. Pengaruh <i>Return on Asset</i> (ROA) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	149
F. Pengaruh <i>Current Ratio</i> (CR) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	151
G. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	154
H. Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> (TATO) terhadap <i>Return Saham</i> Perusahaan yang Tergabung dalam Indeks Sri Kehati Periode 2020-2024	156
BAB VI PENUTUP	158
A. Kesimpulan	158
B. Saran	161
DAFTAR PUSTAKA.....	163
LAMPIRAN.....	170

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Data SDGs Score Indonesia Tahun 2020 – 2024.....	2
Tabel 3. 1 Skala Pengukuran Penelitian.....	84
Tabel 3. 2 Daftar Sampel.....	86
Tabel 4. 1 Data Environmental Social Governance (ESG) Tahun 2020 – 2024....	116
Tabel 4. 2 Data Kapitalisasi Pasar Tahun 2020 – 2024.....	117
Tabel 4. 3 Data Dividend Payout Ratio Tahun 2020 – 2024.....	118
Tabel 4. 4 Data Return on Asset (ROA) Tahun 2020 – 2024.....	119
Tabel 4. 5 Data Current Ratio (CR) Tahun 2020 – 2024.....	120
Tabel 4. 6 Data Debt to Equity Ratio (DER) Tahun 2020 – 2024.....	122
Tabel 4. 7 Data Total Asset Turnover (TATO) Tahun 2020 – 2024.....	123
Tabel 4. 8 Data Return saham Tahun 2020 – 2024.....	124
Tabel 4. 9 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	125
Tabel 4.10 Hasil Uji Chow.....	127
Tabel 4.11 Hasil Uji Hausman.....	128
Tabel 4.12 Hasil Uji Lagrange Multiplier.....	129
Tabel 4.13 Hasil Fixed Effect Model (FEM).....	129
Tabel 4.14 Hasil Uji Multikolinearitas.....	133
Tabel 4.15 Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	134
Tabel 4.16 Hasil Uji Simultan (Uji F).....	135
Tabel 4.17 Hasil Uji Parsial (Uji T).....	136
Tabel 4.18 Hasil Koefisien Determinasi.....	139

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Grafik <i>Return</i> Saham Tahun 2020-2023	5
Gambar 1. 2 Grafik <i>Skor ESG</i> dan <i>Return</i> Saham Tahun 2020-2024	8
Gambar 1. 3 Grafik Kapitalisasi Pasar dan <i>Return</i> Saham Tahun 2020-2024	10
Gambar 1. 4 Grafik <i>Dividend Payout Ratio</i> dan <i>Return</i> Saham Periode 2020-2024	12
Gambar 1. 5 Grafik <i>Return on Assets</i> (ROA) dan <i>Return</i> Saham Periode 2020-2024	14
Gambar 1. 6 Grafik <i>Current Ratio</i> (CR) dan <i>Return</i> Saham Periode 2020-2024	16
Gambar 1. 7 Grafik Debt to Equity Ratio (DER) dan <i>Return</i> Saham Periode 2020-2024	18
Gambar 1. 8 Grafik <i>Total Asset Turnover</i> (TATO) dan <i>Return</i> Saham Periode 2020-2024	20
Gambar 2. 1 Kerangka Teori	77
Gambar 4.1 Hasil Uji Normalitas	132

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Tabulasi Data	170
Lampiran 2 Hasil Output Olah Data (Eviews 12).....	174
Lampiran 3 Kendali Bimbingan.....	176
Lampiran 4 Biodata Penulis.....	193