

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMANJUDUL	i
HALAMANPERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
HALAMANPENGESEAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAANORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vi
KATAPENGANTAR	viii
DAFTARTABEL	xii
DAFTARGAMBAR	xiii
DAFTARLAMPIRAN.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1Latar Belakang Masalah	1
1.2RumusanMasalah.....	7
1.3Tujuan Penelitian.....	8
1.4SistematikaPenulisan.....	9
BABII TELAAH PUSTAKA.....	11
2.1Landasan Teori.....	11
2.1.1 <i>Stakeholder Theory</i>	11
2.1.2 <i>Signaling Theory</i>	13
2.1.3 <i>Return Saham</i>	16
2.1.3.1 <i>Pengertian Return Saham</i>	16
2.1.4. <i>Beta Saham</i>	19
2.1.4.1 <i>Pengertian Beta Saham</i>	19
2.1.4.2. <i>Pengaruh Beta Saham Terhadap Return Saham</i>	19
2.1.5. <i>Firm Size</i>	20
2.1.5.1. <i>Pengertian Firm Size</i>	20
2.1.5.2. <i>Pengaruh Firm size Terhadap Return Saham</i>	21
2.1.6. <i>Book to Market Ratio</i>	22
2.1.6.1 <i>Pengertian Book to Market Ratio</i>	22
2.1.6.2. <i>Pengaruh Book to Market Ratio Terhadap Return Saham</i>	24
2.1.7. <i>Corporate Social Responsibility</i>	24
2.1.7.1 <i>Pengertian Corporate Social Responsibility</i>	24
2.1.7.2. <i>Pengaruh CSR Pekerja Terhadap Return Saham</i>	28
2.1.7.3. <i>Pengaruh CSR untuk Lingkungan terhadap Return Saham</i>	29
2.1.7.4. <i>Pengaruh CSR untuk Komunitas terhadap Return Saham</i>	30
2.2. Penelitian Terdahulu	31
2.3. Kerangka Pemikiran	34
2.4. Hipotesis	35
BABIII METODE PENELITIAN	37
3.1 Definisi Operasional Variabel.....	37

3.1.1 Variabel Penelitian	37
3.1.2 Variabel Dependen	38
3.1.2.1 <i>Return Saham</i>	38
3.1.3. Variabel Independen	39
3.1.3.1 <i>Beta Saham</i>	39
3.1.3.2 <i>Firm Size</i>	40
3.1.3.3 <i>Book to Market Ratio</i>	41
3.1.3.4 <i>CSR untuk Pekerja</i>	41
3.1.3.5 <i>CSR untuk Lingkungan</i>	42
3.1.3.6 <i>CSR untuk Komunitas</i>	42
3.1.3 Variabel Dependen	40
3.2 Populasi dan Sampel	43
3.3 Jenis dan Sumber Data	44
3.1.3.1 <i>Corporate Social responsibility</i>	41
3.2 Populasi dan Sampel	42
3.3 Jenis dan Sumber Data	43
3.4 Metode Pengumpulan Data	43
3.5 Metode Analisis	45
3.5.1 Pengujian Asumsi Klasik	46
3.5.1.1 Uji Normalitas	46
3.5.1.2 Uji Multikolinearitas	47
3.5.1.3 Uji Heteroskedastisitas	47
3.5.2 Uji Hipotesis	48
3.5.2.1 Uji Hipotesis Secara Simultan	48
3.5.2.2 Uji Hipotesis Secara Parsial	48
3.5.2.3 Koefisien Determinasi	49
BABIV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN	51
4.1 Hasil Penelitian	51
4.1.1 Deskripsi Variabel Penelitian	51
4.1.2 Analisis Data	53
4.1.2.1 Uji Asumsi Klasik	53
4.1.2.2 Uji Regresi	57
4.1.2.3 Uji Hipotesis Penelitian	59
4.2 Pembahasan	61
4.2.1 Pengaruh <i>Beta</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	62
4.2.2 Pengaruh <i>Size</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	62
4.2.3 Pengaruh <i>Book to Market</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	63
4.2.4 Pengaruh <i>CSR Untuk Karyawan</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	64
4.2.5 Pengaruh <i>CSR Untuk Lingkungan</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	65
4.2.6 Pengaruh <i>CSR Untuk Komunitas</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	65
BABV PENUTUP	66
5.1 Simpulan	66
5.2 Keterbatasan	67
5.3 Saran	67
DAFTAR PUSTAKA	69