

Tujuan dari penelitian yang saya lakukan adalah untuk mengetahui apakah terdapat pengaruh dari *Corporate Social Responsibility* terhadap *return* saham.

Jenis penelitian ini merupakan kuantitatif. Data yang diperlukan adalah data sekunder yang didapatkan dengan mengumpulkan laporan tahunan periode 2016-2020 dan *return* saham perusahaan yang terdaftar di BEI. Sumber data penelitian adalah untuk CSR diambil dari komponen penilaian dalam bentuk skor untuk *social* saja yang diperoleh dari website Bloomberg Skor ESG, sedangkan untuk *return* saham dihitung dari harga saham yang diperoleh dari yahoo.finance dan idx.co.id. Dalam penelitian tersebut juga menambahkan dua variabel lain sebagai variabel kontrol, yaitu *Debt to Equity Ratio*, dan *Dividend Payout Ratio*. Teknik analisis data yang digunakan adalah Statistik Deskripsi, Uji Asumsi Klasik (Normalitas, Multikolinearitas, Heteroskedastisitas, Autokorelasi), dan Uji Hipotesis (Regresi Linear Berganda, Uji T, dan Uji F).

Hasil penelitian menunjukkan bahwa untuk uji asumsi klasik pada uji normalitas data yang diuji berdistribusi normal, pada uji heteroskedastisitas data yang diuji tidak terjadi heteroskedastisitas, pada uji multikolinearitas data yang diuji tidak ditemukannya multikolinearitas, dan pada uji autokorelasi data yang diuji terdapat autokorelasi. Sedangkan untuk uji hipotesis pada uji T, variabel yang diuji saling berpengaruh antara satu dengan yang lain dan pada uji F, variabel yang diuji berpengaruh secara signifikan.

Kata Kunci: CSR, DER, DPR, dan *Return* Saham

## ABSTRACT

*The purpose of my research is to find out whether there is an effect of Corporate Social Responsibility on stock returns.*

*This type of research is quantitative. The data needed is secondary data obtained by collecting annual reports for the 2016-2020 period and stock returns of companies listed on the IDX. The source of research data is CSR taken from the assessment component in the form of scores for social only obtained from the Bloomberg website ESG Score, while for stock returns calculated from stock prices obtained from yahoo.finance and idx.co.id. The study also added two other variables as control variables, namely the Debt to Equity Ratio, and the Dividend Payout Ratio. The data analysis techniques used were Descriptive Statistics, Classical Assumption Test (Normality, Multicollinearity, Heteroscedasticity, Autocorrelation), and Hypothesis Testing (Multiple Linear Regression, T Test, and F Test).*

*The results showed that for the classical assumption test in the normality test the data tested were normally distributed, the heteroscedasticity test of the tested data did not occur heteroscedasticity, the multicollinearity test of the tested data did not find multicollinearity, and the autocorrelation test of the tested data showed autocorrelation. Meanwhile, to test the hypothesis on the T test, the variables tested have an effect on each other and in the F test, the variables tested have a significant effect.*

*Keywords: CSR, DER, DPR, and Stock Return*