

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
ABSTRAK	xi
ABSTRACT	xii
BAB I	
PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	10
1.3 Pertanyaan Penelitian	11
1.4 Tujuan Penelitian	12
1.5 Manfaat Penelitian	13
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	13
1.7 Sistematika Penulisan	14
BAB II	
LANDASAN TEORI.....	16
2.1 Landasan Teori	16
2.1.1 Rasio <i>Risk-Adjusted Return</i>	16
2.1.1.1 <i>Sharpe Index Performance Measure</i>	16
2.1.1.2 <i>Treynor's Index Performance Measure</i>	17
2.1.2 <i>Liquidity/Illiquidity</i>	17
2.1.3 <i>Environment, Social, and Governance (ESG)</i>	19
2.1.4 Indeks SRI KEHATI.....	20
2.1.5 <i>Risk-return Performance</i>	22
2.1.6 <i>Time Series Analysis</i>	23
2.1.6.1 Analisis Regresi	23
2.1.6.2 Analisis Statistik Durbin-Watson	24
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis	26
2.2.1 Teori Triple Bottom Line	26
2.2.2 Teori Portfolio.....	26
2.2.3 <i>Doing Well While Doing Good Perspective</i>	27
2.2.4 Dampak ESG Pada Profitabilitas Portfolio	28
2.2.5 Dampak Saham-Saham ESG Selama Masa Pandemi COVID-19	28
2.2.6 Kaitan Antara ESG, Likuiditas, dan <i>Stock Returns</i>	29
2.2.7 Performa ESG Pada Perusahaan Selama Masa Pandemi COVID-19.....	29
2.2.8 Model <i>Financial</i> Peningkatan Nilai Indeks ESG	30
2.2.9 Performa Indeks SKI Di Indonesia	30
2.3 Penyusunan Hipotesis	31
2.4 Model Penelitian	31
BAB III	
METODA PENELITIAN.....	33
3.1 Desain Penelitian	33
3.2 Populasi dan Sampel.....	33

3.3 Variabel Penelitian	34
3.4 Metode Pengujian Hipotesis	36
BAB IV	
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	40
4.1 Deskripsi Sampel Penelitian	40
4.2 Analisis Statistik Deskriptif	43
4.3 Uji Beda	45
4.4 Analisis Regresi	49
4.4.1 Analisis Regresi Variabel Y (<i>Return</i>)	50
4.4.2 Analisis Regresi Variabel Y (Sharpe Ratio)	56
4.4.3 Analisis Regresi Variabel Y (Treynor Ratio)	61
4.4.4 Analisis Regresi Variabel Y (likuiditas)	67
4.5 Hasil Analisis Hipotesis	72
BAB V	
KESIMPULAN DAN SARAN	75
5.1 Kesimpulan	75
5.2 Keterbatasan	76
5.3 Saran	77
DAFTAR PUSTAKA	78
LAMPIRAN.....	81