

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN.....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN.....</b>	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>iv</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>v</b>
<b>DAFTAR TABEL.....</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>x</b>
<b>INTISARI.....</b>	<b>xi</b>
<b>ABSTRACT.....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1    Latar Belakang .....	1
1.2    Rumusan Masalah .....	4
1.3    Pertanyaan Penelitian .....	5
1.4    Tujuan Penelitian .....	6
1.5    Manfaat Penelitian .....	6
1.6    Lingkup Penelitian .....	7
1.7    Sistematika Penelitian .....	9
<b>BAB II LANDASAN TEORI .....</b>	<b>10</b>
2.1    Investasi.....	10
2.2    Pasar Saham .....	12

2.3	Risiko dan Imbal Hasil ( <i>Risk &amp; Return</i> ) .....	13
2.4	Evaluasi Kinerja Portofolio .....	15
2.4.1	Sharpe Ratio .....	15
2.4.2	Treynor Ratio .....	16
2.4.3	Jensen's Alpha .....	16
2.5	Socially Responsible Investing (SRI) .....	17
2.6	Stakeholder Theory .....	19
2.7	Agency Theory .....	20
2.8	Kajian Penelitian Terdahulu .....	22
2.9	Pengembangan Hipotesis .....	24
2.10	Model Penelitian .....	26
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>		<b>28</b>
3.1	Desain Penelitian .....	28
3.2	Metode Pengumpulan Data .....	28
1.2.1.	Populasi dan Sampel .....	29
1.2.2.	Langkah Pengumpulan Data .....	30
3.3	Instrumen Penelitian .....	30
3.4	Metode Analisis Data .....	32
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN &amp; PEMBAHASAN .....</b>		<b>34</b>
4.1	Pengumpulan Data .....	34
4.2	Analisis Deskriptif .....	36
4.2.1	Analisis Deskriptif Per Negara ASEAN .....	36
4.2.2	Analisis Perbandingan Antar Negara ASEAN .....	40



4.3	Analisis Statistik dan Uji Hipotesis.....	41
4.4	Diskusi.....	45
4.4.1	Indonesia .....	46
4.4.2	Malaysia .....	47
4.4.3	Singapura.....	47
4.4.4	Thailand.....	48
4.4.5	Analisis Lintas Negara .....	48
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>		<b>51</b>
5.1	Kesimpulan .....	51
5.1.1	Perbedaan Return .....	51
5.1.2	Perbedaan Risiko (Volatilitas) .....	52
5.1.3	Perbedaan <i>Risk-Adjusted Performance</i> .....	52
5.2	Keterbatasan.....	53
5.3	Saran.....	54
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>57</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>		<b>60</b>