

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>ii</b>
<b>PERNYATAAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>iv</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>vi</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xi</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>xii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>xiii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	6
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	6
1.4 Tujuan Penelitian .....	7
1.5 Manfaat Penelitian .....	7
1.6 Lingkup Penelitian .....	8
1.7 Sistematika Penulisan .....	8
<b>BAB II LANDASAN TEORI</b> .....	<b>10</b>
2.1 <i>Corporate Social Responsibility</i> .....	10

2.2 <i>Sustainable and Responsible Investment</i> .....	12
2.3 Indeks SRI-KEHATI .....	14
2.4 Kinerja Perusahaan dan Risiko Perusahaan .....	16
2.5 Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis .....	18
2.6 Model Penelitian .....	21
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b> .....	<b>23</b>
3.1 Populasi dan Sampel Penelitian .....	23
3.2 Jenis dan Sumber Data Penelitian .....	25
3.3 Definisi Operasional Variabel .....	25
3.4 Metode Analisis Data .....	29
3.4.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	29
3.4.2 Uji beda t-test .....	29
3.4.3 Uji Asumsi Klasik .....	29
3.4.4 Analisis Regresi .....	31
3.5 Metode Pengujian Hipotesis .....	32
3.5.1 Metode Estimasi Model Data Panel .....	32
3.5.2 Uji F .....	33
3.5.3 Uji T .....	33
3.5.4 Koefisien Determinasi .....	34
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b> .....	<b>35</b>
4.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	35
4.2 Uji Asumsi Klasik .....	39

4.2.1 Uji Normalitas .....	40
4.2.2 Uji Autokorelasi .....	40
4.2.3 Uji Multikolinearitas .....	41
4.2.4 Uji Heteroskedastisitas .....	42
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis .....	43
4.3.1 Hasil Uji Regresi Data Panel .....	43
4.3.2 Pemilihan Model Terbaik Data Panel .....	44
4.3.3 Metode GLS .....	45
4.4 Pembahasan Uji Hipotesis .....	46
4.4.1 Analisis Regresi Linier Berganda berbasis OLS .....	46
4.4.2 Analisis Regresi Linier Berganda berbasis GLS .....	50
<b>BAB V SIMPULAN .....</b>	<b>54</b>
5.1 Simpulan .....	54
5.2 Keterbatasan Penelitian .....	55
5.3 Implikasi .....	56
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>58</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>	<b>61</b>

## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Daftar Perusahaan dalam Kategori SRI (2009-2015) .....	24
Tabel 4.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	36
Tabel 4.2 Hasil Uji Normalitas .....	40
Tabel 4.3 Hasil Uji Autokorelasi (Uji LM) .....	40
Tabel 4.4 Koefisien Korelasi Antar Variabel .....	41
Tabel 4.5 Hasil Uji Heteroskedastisitas .....	42
Tabel 4.6 Hasil Perhitungan Regresi berbasis OLS .....	43
Tabel 4.7 Hasil Uji <i>Breusch-Pagan Random Effect LM Test</i> .....	44
Tabel 4.8 Hasil Perhitungan Regresi berbasis GLS .....	46

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Pergerakan Indeks LQ45 dan Indeks SRI-KEHATI (Periode 1 Januari 2007-29 Januari 2010) .....	4
Gambar 2.1 Model Penelitian .....	22

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data Variabel Penelitian .....	62
Lampiran 2 Hasil Olah Data Independent t-test .....	71
Lampiran 3 Hasil Asumsi Klasik Normalitas .....	74
Lampiran 4 Hasil Asumsi Klasik Autokorelasi .....	76
Lampiran 5 Hasil Asumsi Klasik Multikolinearitas .....	78
Lampiran 6 Hasil Asumsi Klasik Heteroskedastisitas .....	79
Lampiran 7 Hasil Olah Data Metode <i>Common Effect Model</i> .....	80
Lampiran 8 Hasil Olah Data Metode <i>Random Effect Model</i> .....	82
Lampiran 9 Hasil Olah Data <i>Lagrange-Multiplier</i> .....	84
Lampiran 10 Hasil Olah Data Metode <i>Generalized Least Square</i> .....	85