

## **ABSTRAK**

Kevin Utama (01011180070)

### **PENGARUH ENVIRONMENTAL AND SUSTAINABLE POLICIES TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN VOLATILITAS RETURN SAHAM SELAMA PANDEMI COVID 19**

(xii + 79 halaman : 21 tabel; 8 lampiran)

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui pengaruh lingkungan, sosial, dan tata kelola perusahaan terhadap abnormal return dan volatilitas return saham pada 25 perusahaan yang terdapat di Index ESG Leaders selama 3 kuartal, dimulai dari kuartal 4 2020 sampai kuartal 2 2021. Metode analisis data yang digunakan yaitu uji chow, uji hausman, uji Langrage Multiplier, serta uji diagnostik. Hasil penelitian menunjukkan bahwa lingkungan, sosial, dan tata kelola tidak memiliki pengaruh apa- apa terhadap abnormal return dan volatilitas return.

Kata Kunci: ESG, Abnormal Return, Volatilitas return

Referensi : 28 (2000-2021)