

## DAFTAR ISI

<b>PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TUGAS AKHIR.....</b>	<b>ii</b>
<b>PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR .....</b>	<b>iii</b>
<b>PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR.....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>v</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>vi</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xiii</b>
<b>BAB 1 PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Batasan Masalah.....	5
1.3 Rumusan Masalah .....	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	6
1.5.1 Manfaat Praktis .....	6
1.5.2 Manfaat Teoritis .....	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	7
<b>BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>9</b>
2.1 Pasar Efisien .....	9
2.2 Signalling “Theory .....	10
2.3 <i>Stock Price Volatility</i> .....	11
2.4 ESG .....	13

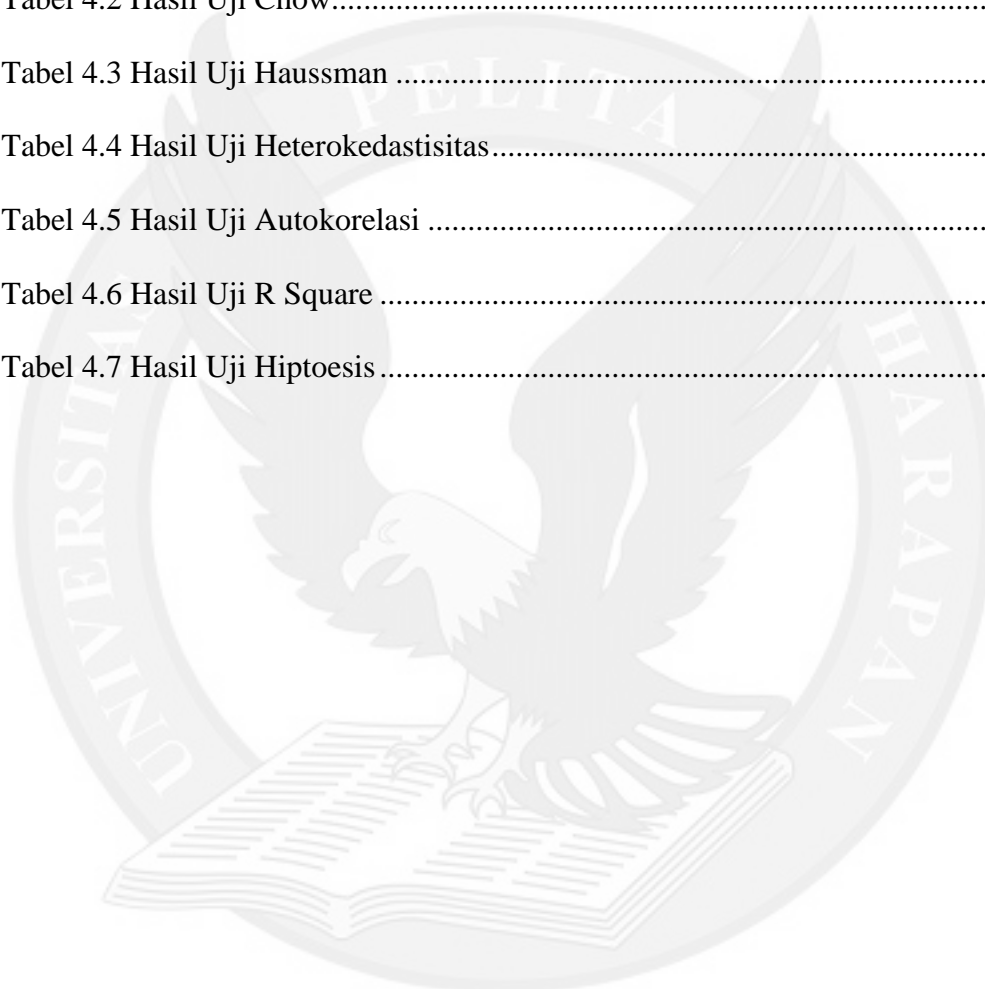
2.5	<i>Financial crisis</i> .....	14
2.6	Pengaruh <i>ESG performance</i> terhadap <i>Stock Price Volatility</i> .....	18
2.7	Pengaruh Finansial Crisis terhadap <i>Stock Price Volatility</i> .....	19
<b>BAB 3</b>	<b>METODE PENELITIAN</b> .....	<b>22</b>
3.1	Data .....	22
3.2	Model Empiris .....	23
3.3	Operasionalisasi Variabel .....	23
3.3.1	Variabel Dependen .....	23
3.3.2	Variabel Independen .....	24
3.3.3	Variabel Kontrol .....	26
3.4	Teknik Analisa Data .....	28
3.4.1	Regresi Data Panel .....	28
3.4.2	Pemilihan Model Terbaik .....	29
3.4.3	Asumsi Klasik .....	31
<b>BAB 4</b>	<b>HASIL ANALISA DAN PEMBAHASAN</b> .....	<b>33</b>
4.1	Analisis Deskriptif .....	33
4.2	Pengujian Regresi Data Panel .....	35
4.2.1	Uji Chow .....	35
4.2.2	Uji Hausman .....	36
4.3	Uji Asumsi Klasik .....	37
4.3.1	Uji Heterokedastisitas .....	37
4.3.2	Uji Autokorelasi .....	38
4.4	Hasil Empiris .....	38
<b>BAB 5</b>	<b>KESIMPULAN DAN IMPLIKASI MANAJERIAL</b> .....	<b>44</b>
5.1	Kesimpulan .....	44
5.2	Implikasi Manajerial .....	44

5.3 Keterbatasan dan Saran Penelitian Selanjutnya .....	45
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>47</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>1</b>



## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Perhitungan Jumlah Sampel.....	22
Tabel 3.2 Operasionalisasi Variabel Kontrol.....	26
Tabel 4.1 Hasil Analisa Deskriptif.....	33
Tabel 4.2 Hasil Uji Chow.....	36
Tabel 4.3 Hasil Uji Hausman .....	37
Tabel 4.4 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	37
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi .....	38
Tabel 4.6 Hasil Uji R Square .....	39
Tabel 4.7 Hasil Uji Hiptoesis.....	40



## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Volatilitas Pasar Saham Indonesia .....	2
--	---

