

DAFTAR ISI

	Halaman
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRACT.....	iii
ABSTRAK.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	12
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	12
1. Tujuan Penelitian	12
2. Kontribusi Penelitian.....	13
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
A. Kajian Pustaka.....	14
1. Stakeholder Theory.....	14
2. Signaling Theory	15
3. Pasar Modal.....	15

4. Return Saham	16
4.1. Pengertian Return Saham.....	16
4.2. Faktor-faktor yang mempengaruhi Return Saham.....	18
4.3. Risiko Investasi.....	19
5. <i>Return On Asset</i>	21
5.1. Pengertian <i>Return On Asset</i>	21
5.2. Pengaruh <i>Return On Asset</i> terhadap Return Saham.....	22
6. <i>Corporate Social Responsibility</i>	22
6.1. Pengertian <i>Corporate Social Responsibility</i>	22
6.2. Pengungkapan <i>Corporate Social Responsibility</i>	24
6.3. Manfaat Pengungkapan <i>Corporate Social Responsibility</i>	25
6.4. Model Pelaksanaan <i>Corporate Social Responsibility</i>	27
6.5. Pengaruh Pengungkapan <i>Corporate Social Responsibility</i> terhadap Return Saham.....	28
7. <i>Firm Size</i>	29
7.1. Pengertian <i>Firm Size</i>	29
7.2. Manfaat <i>Firm Size</i>	30
7.3. Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap Return Saham	30
8. Penelitian Terdahulu	31
B. Rerangka Pemikiran	43
C. Hipotesis	48

BAB III METODE PENELITIAN

A. Waktu dan Tempat Penelitian	49
B. Desain Penelitian	49
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	51
D. Populasi dan Sampel Penelitian	54
E. Teknik Pengumpulan Data	58
F. Metode Analisis	58
1. Statistik Deskriptif	58
2. Uji Analisis Regresi data Panel	58
1. Metode <i>Common Effect Model</i>	59
2. Metode <i>Fixed Effect Model</i>	60
3. Metode <i>Random Effect model</i>	60
3. Pemilihan model Regresi Data Panel	61
1. Uji Chow	61
2. Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	63
4. Uji Hipotesis	64
1. Uji Kesesuaian Model (Uji F)	64
2. Koesifien Determinasi (R ²)	64
3. Uji Hipotesis t (Uji T)	65

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum	66
B. Hasil Uji Statistik Deskriptif	66

1. Analisis Statistik Deskriptif	66
C. Analisis Regresi Data Panel	69
1. Metode <i>Common Effect Model</i>	70
2. Metode <i>Fixed Effect Model</i>	71
3. Metode <i>Random Effect model</i>	73
D. Pemilihan model Regresi Data Panel	74
1. Uji Chow	74
2. Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	75
E. Model Regresi Data Panel	77
F. Hasil Pengujian Hipotesis	78
1. Uji Kesesuaian Model (Uji F).....	78
2. Koesifien Determinasi (R ²).....	80
3. Uji Hipotesis t (Uji T)	80
G. Pembahasan Hasil Penelitian	83
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	87
B. Saran.....	88
DAFTAR PUSTAKA	89
LAMPIRAN	93