

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	9
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	9
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	9
BAB II TELAAH PUSAKA	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 <i>Adaptive Market Hypothesis</i> AMH.....	11
2.1.2 <i>Behavioral Finance</i>	11
2.1.3 Noise Trader Theory	12
2.2 Definisi Konsep.....	12
2.2.1 <i>Return Saham</i>	12
2.2.2 ESG dan ESG <i>Disagreement</i>	13
2.2.3 Investor sentiment.....	14
2.2.4 <i>Trading Volume</i>	14
2.3 Penelitian terdahulu.....	14
2.3.1 Pengaruh ESG <i>Disagreement</i> terhadap <i>Return Saham</i>	14
2.3.2 Pengaruh <i>Investor Sentiment</i> terhadap <i>Return Saham</i>	15
2.3.3 Pengaruh <i>Trading Volume</i> terhadap <i>Return Saham</i>	16
2.4 Pengaruh Antara Variabel dan Perumusan Hipotesis	21
2.4.1 Pengaruh ESG <i>Disagreement</i> terhadap <i>Return Saham</i>	21
2.4.2 Pengaruh <i>Investor Sentiment</i> terhadap <i>Return Saham</i>	22

2.4.3 Pengaruh <i>Trading Volume</i> terhadap <i>Return Saham</i>	23
2.5 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	24
2.6 Hipotesis Penelitian.....	24
BAB III METODE PENELITIAN	26
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	26
3.1.1 Variabel Terikat Dependen	26
3.1.2 Variabel Bebas <i>Independent</i>	26
3.2 Populasi dan Sampel	29
3.2.1 Populasi	29
3.2.2 Sampel.....	30
3.3 Jenis dan Sumber Data	30
3.3.1 Jenis Data	30
3.3.2 Sumber Data.....	31
3.4 Metode Analisis.....	31
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	34
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	34
4.2 Analisis Data	35
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	35
4.2.2 Uji Normalitas Residual	39
4.2.3 Transformasi Data	40
4.2.4 Uji Pemilihan Model Data Panel.....	43
4.2.5 Uji Asumsi Klasik	44
4.2.6 Hasil Estimasi Regresi	46
4.3 Pengujian Hipotesis.....	46
4.3.1 Pengaruh <i>ESG Disagreement</i> terhadap <i>Return Saham H1</i>	47
4.3.2 Pengaruh <i>Investor Sentiment</i> terhadap <i>Return Saham H2</i>	48
4.3.3 Pengaruh <i>Trading Volume</i> terhadap <i>Return Saham H3</i>	49
BAB V PENUTUP	51
5.1 Kesimpulan	51
5.2 Keterbatasan Penelitian	52
5.3 Saran.....	52
DAFTAR PUSTAKA.....	55
LAMPIRAN.....	59