

ABSTRAK

PENGARUH PENGUNGKAPAN *SUSTAINABLE DEVELOPMENT GOALS* (SDGs) DAN RISIKO SISTEMATIS TERHADAP *RETURN SAHAM*

(Studi Empiris pada Perusahaan yang terdaftar di Jakarta *Islamic Index* Periode 2017-2021)

Disusun Oleh:

ANDINI DERA JAELANI

9882405119221005

Return saham merupakan keuntungan yang diperoleh investor pada saat melakukan investasi. Investor pada saat melakukan investasi baik pada pasar modal konvensional atau pasar modal syariah perlu melihat tingkat *return* yang akan di peroleh dari investasi yang dilakukannya. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui seberapa besar pengaruh pengungkapan *Sustainable Development Goals* (SDGs) dan risiko sistematis terhadap *return* saham pada Perusahaan yang terdaftar di Jakarta *Islamic Index* Periode 2017-2021. Sampel pada penelitian sebanyak 12 perusahaan dengan teknik pengambilan sampel *purposive sampling*. teknik pengumpulan data menggunakan dokumentasi dari *sustainability report* perusahaan yang dipublikasikan di *website* resmi Bursa Efek Indonesia www.idx.co.id. Teknik pengujian data menggunakan uji asumsi klasik, regresi linear berganda, koefisien korelasi, koefisien detrminasi, dan uji hipotesis. Hasil menunjukkan bahwa secara simultan pengungkapan *Sustainable Development Goals* (SDGs) dan risiko sistematis berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan secara parsial pengungkapan *Sustainable Development Goals* (SDGs) tidak berpengaruh terhadap *return* saham dan risiko sistematis berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata kunci: *Sustainable Development Goals* (SDGs), risiko sistematis, *return* saham

ABSTRACT

THE EFFECT OF SUSTAINABLE DISCLOSURES DEVELOPMENT GOALS (SDGs) AND RISK SYSTEMATIC ON STOCK RETURN

(Emprical study of companies on Jakarta Islamic Index period 2017-2021)

Arranged by:

ANDINI DERA JAELANI

9882405119221005

Stock returns are the profits obtained by investors when investing. Investors when investing in either the conventional capital market or the sharia capital market need to look at the level of return they will get from the investment they make. This research aims to find out how much influence disclosure of Sustainable Development Goals (SDGs) and systematic risk has on stock returns in companies listed on the Jakarta Islamic Index for the 2017-2021 period. The sample in the study was 12 companies using a purposive sampling technique. Data collection techniques use documentation from company sustainability reports published on the official website of the Indonesia Stock Exchange www.idx.co.id. Data testing techniques use classical assumption tests, multiple linear regression, correlation coefficient, determination coefficient, and hypothesis testing. The results show that simultaneously disclosing Sustainable Development Goals (SDGs) and systematic risk have an effect on stock returns. Meanwhile, partial disclosure of Sustainable Development Goals (SDGs) has no effect on stock returns and systematic risk has an effect on stock returns.

Keywords: *Sustainable Development Goals (SDGs), systematic risk, stock returns*