

DAFTAR ISI

| | |
|---|-------------|
| LEMBAR PENGESAHAN | ii |
| BERITA ACARA UJIAN SKRIPSI..... | iii |
| SURAT PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI | iv |
| KATA PENGANTAR..... | v |
| ABSTRACT | vii |
| ABSTRAK | viii |
| DAFTAR ISI..... | ix |
| DAFTAR TABEL..... | xi |
| DAFTAR GAMBAR..... | xii |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1 Latar Belakang Masalah..... | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah..... | 6 |
| 1.3 Tujuan Penelitian | 6 |
| 1.4 Kontribusi Penelitian | 6 |
| 1.5 Sistematika Penulisan | 7 |
| BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA..... | 10 |
| 2.1 Landasan Teori..... | 10 |
| 2.1.1 <i>Arbitrage Pricing Theory (APT)</i> | 10 |
| 2.1.2 <i>Teori Behavioral Finance</i> | 11 |
| 2.1.3 <i>Signaling Theory</i> | 13 |
| 2.2 Tinjauan Pustaka | 15 |
| 2.3 Rerangka Konseptual..... | 16 |
| 2.4 Pengembangan Hipotesis..... | 17 |
| 2.4.1 GSVI berpengaruh positif terhadap <i>Return Saham</i> | 17 |
| 2.4.2 Inflasi berpengaruh negatif terhadap <i>Return Saham</i> | 19 |
| 2.4.3 <i>Dividend Payout Ratio</i> berpengaruh positif terhadap <i>Return Saham</i> | 20 |

| | |
|--|-----------|
| BAB III METODE PENELITIAN | 23 |
| 3.1 Rancangan Penelitian..... | 23 |
| 3.2 Populasi dan Sampel | 23 |
| 3.3 Variabel dan Definisi Operasional VariabelA | 24 |
| 3.3.1 Variabel dependen..... | 25 |
| 3.3.2 Variabel independen..... | 26 |
| 3.4 Teknik Pengumpulan Data..... | 28 |
| 3.5 Teknik Analisis Data..... | 28 |
| 3.5.1 Statistik deskriptif | 29 |
| 3.5.2 Uji asumsi klasik | 29 |
| 3.5.3 Uji <i>Goodness of Fit</i> | 31 |
| BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... | 34 |
| 4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian..... | 34 |
| 4.2 Hasil Analisis..... | 36 |
| 4.2.1 Hasil perhitungan varibel penelitian..... | 36 |
| 4.2.2 Analisis statistik deskriptif..... | 36 |
| 4.2.3 Uji asumsi klasik | 37 |
| 4.2.4 Uji <i>Goodness of Fit</i> | 43 |
| 4.3 Pembahasan | 46 |
| 4.3.1 Pengaruh Google Search Volume Index terhadap <i>Return Saham</i> | 46 |
| 4.3.2 Pengaruh Inflasi terhadap <i>Return Saham</i> | 48 |
| 4.3.3 Pengaruh <i>Dividend Payout Ratio</i> (DPR) terhadap <i>Return Saham</i> | 50 |
| BAB V KESIMPULAN..... | 53 |
| 5.1 Kesimpulan | 53 |
| 5.2 Keterbatasan..... | 54 |
| 5.1 Saran..... | 55 |
| DAFTAR PUSTAKA | 57 |
| LAMPIRAN..... | 60 |

DAFTAR TABEL

| | |
|---|----|
| Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Terdahulu | 15 |
| Tabel 4.1 Perician Pemilihan Sampel tahun 2020–2024..... | 35 |
| Tabel 4.2 Hasil Analisis Statistik Deskriptif..... | 37 |
| Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas | 38 |
| Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas | 39 |
| Tabel 4.5 Hasil Uji Heteroskedastisitas | 41 |
| Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi..... | 42 |
| Tabel 4.7 Hasil Uji Koefisien Determinasi | 43 |
| Tabel 4.8 Hasil Uji Signifikansi Anova (Uji F) | 44 |
| Tabel 4.9 Hasil Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t) | 45 |

DAFTAR GAMBAR

| | |
|--------------------------------------|----|
| Gambar 2.1 Rerangka Konseptual | 17 |
|--------------------------------------|----|