

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Batasan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Model Regresi	7
2.1.1 Model Regresi Linier Sederhana.....	7
2.1.2 Model Regresi Linier Berganda.....	8
2.2 Data Panel	9
2.3 Regresi Data Panel	12
2.4 Pemodelan Model Regresi Data Panel.....	13
2.4.1 <i>Common Effect Model (CEM)</i>	13
2.4.2 <i>Fixed Effect Model (FEM)</i>	15
2.4.3 <i>Random Effect Model (REM)</i>	18
2.5 Uji Spesifikasi Model.....	21

2.5.1 Uji Chow	21
2.5.2 Uji Hausman.....	22
2.5.3 Uji Lagrange Multiplier	24
2.6 Uji Asumsi	25
2.6.1 Uji Normalitas	25
2.6.2 Uji Multikolinieritas.....	26
2.6.3 Uji Heteroskedastisitas.....	27
2.6.4 Uji Autokorelasi	29
2.7 Pengujian Parameter Signifikansi	31
2.7.1 Uji Serentak (Uji F).....	31
2.7.2 Uji Parsial (Uji t).....	32
2.8 Saham.....	33
2.9 Profitabilitas	34
2.9.1 Jenis-jenis Profitabilitas	35
2.10 Dividen.....	37
2.10.1 <i>Dividend Payout Ratio</i> (DPR).....	38
BAB III METODE PENELITIAN	40
3.1 Jenis dan Sumber Data	40
3.2 Variabel Penelitian	40
3.3 Tahapan Analisis Data	41
3.4 Diagram Alir Analisis	44
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	45
4.1 Deskripsi Data.....	45
4.2 Model Estimasi Data Panel	47
4.2.1 <i>Common Effect Model</i> (CEM)	47
4.2.2 <i>Fixed Effect Model</i> (FEM)	48
4.2.3 <i>Random Effect Model</i> (REM).....	50
4.3 Uji Signifikansi Parameter	55

4.3.1 Uji Chow	55
4.3.2 Uji Hausman.....	56
4.3.3 Uji Lagrange Multiplier	58
4.4 Uji Asumsi	58
4.4.1 Uji Normalitas	58
4.4.2 Uji Multikolinieritas.....	60
4.4.3 Uji Heteroskedastisitas.....	62
4.4.4 Uji Autokorelasi	63
4.5 Pengujian Parameter Regresi	64
4.5.1 Uji Serentak (Uji F).....	64
4.5.2 Uji Parsial (Uji t).....	65
4.6 Model Akhir Regresi Data Panel	67
BAB V KESIMPULAN.....	69
DAFTAR PUSTAKA	70
LAMPIRAN.....	72