

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL	
DAFTAR GAMBAR	
DAFTAR LAMPIRAN	
1 PENDAHULUAN	1
Latar Belakang	1
Perumusan Masalah	4
Tujuan Penelitian	5
Manfaat Penelitian	6
Ruang Lingkup Penelitian	6
2 TINJAUAN PUSTAKA	6
Kerangka Teoritis	6
Hipotesis Penelitian	10
Penelitian Terdahulu	10
Kerangka Konseptual	15
3 METODE	17
Waktu dan Tempat Penelitian	17
Jenis dan Sumber Data	17
Teknik Pengumpulan Data dan Informasi	18
Teknik Pengambilan Sampel	18
Operasional Variabel	18
Metode Pengolahan Data	20
Pemilihan Model Regresi Data Panel	20
Evaluasi Model	21
Model Peramalan Analisis Trend	21
4 GAMBARAN UMUM	22
Implementasi BASEL III di Indonesia	22
Gambaran Umum Bank BUKU 3 Pada Penelitian	23
Obligasi Bank BUKU 3	29
5 HASIL DAN PEMBAHASAN	31
Analisis Deskripsi	31
Analisis Variabel Independen Terhadap <i>Yield</i> Obligasi Bank BUKU 3	32
Statistik Deskriptif	35
Pengujian Model	36
Interpretasi Model	38
Hasil Peramalan <i>Yield</i> Bank BUKU 3	40
Implikasi Manajerial	53
6 SIMPULAN DAN SARAN	54
Simpulan	54
Saran	54
DAFTAR PUSTAKA	55
LAMPIRAN	58
RIWAYAT HIDUP	72



DAFTAR TABEL

1	<i>Capital requirements and buffers</i> Basel III	1
2	Profil Resiko	1
3	Komponen Modal Basel III	2
4	Sumber Penghimpunan Dana Perbankan Berdasarkan Volume	3
5	Karakteristik Obligasi di Pasar Obligasi Indonesia Mei 2018	5
6	<i>Maturity</i> Obligasi	8
7	Penelitian Terdahulu	12
8	Jenis dan Sumber Data Penelitian	17
9	<i>Rating</i> Obligasi	19
10	Profil Bank BUKU 3	25
11	Rasio Keuangan Bank BUKU 3	26
12	Obligasi Bank BUKU 3	30
13	Statistik Deskriptif	35
14	Hasil Uji Chow	36
15	Hasil Uji Hausman	37
16	Hasil Regresi Data Panel	37
17	Nilai Probability Jarque-Bera	38
18	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	40
19	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	41
20	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	42
21	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	43
22	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	44
23	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	45
24	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	46
25	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	47
26	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	48
27	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	49
28	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	50
29	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	51
30	Estimasi Pemilihan Model Peramalan	52

DAFTAR GAMBAR

1	Kapitalisasi Pasar Obligasi di Indonesia 2018	4
2	Bagan Kerangka Konseptual	16
3	Rasio CAR Bank Buku 3	27
4	Rasio ROE Bank Buku 3	28
5	Rasio NPL Bank Buku 3	29
6	Rata-rata YTM, Harga dan Durasi Obligasi Bank BUKU 3	31
7	Hubungan Kupon dengan <i>Yield To Maturity</i>	33
8	Hubungan Likuiditas dengan <i>Yield To Maturity</i>	33
9	Hubungan <i>Maturity</i> dengan <i>Yield To Maturity</i>	34
10	Hubungan <i>Maturity</i> dengan <i>Yield To Maturity</i>	34
11	Grafik Tren <i>Yield</i> Obligasi	41
12	Grafik Tren <i>Yield</i> Obligasi	42



DAFTAR GAMBAR (LANJUTAN)

13	Grafik Tren <i>Yield</i> Obligas	43
14	Grafik Tren <i>Yield</i> Obligasi	44
15	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	45
16	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	46
17	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	47
18	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	48
19	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	49
20	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	50
21	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	51
22	Grafik Trend <i>Yield</i> Obligasi	52
23	Grafik Tren <i>Yield</i> Obligasi	53

DAFTAR LAMPIRAN

1	Rasio Keuangan Bank BUKU 3	59
2	Yield Obligasi Bank BUKU 3	60
3	Rata – Rata YTM, Harga, dan Durasi Obligasi Bank BUKU 3	62
4	Data Mentah Obligasi Bank BUKU 3	63

