

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL	xii
BAB I.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	3
1.3 Perumusan Masalah.....	9
1.4 Tujuan Penelitian.....	10
1.5 Manfaat Penelitian.....	10
1.5.1 Aspek Teoritis.....	10
1.5.2 Aspek Praktis	11
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	11
BAB II	13
2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu	13
2.1.1 Bank	13
2.1.2 Bisnis Utama Bank	14
2.1.3 Aktifitas Bank Lainnya	15
2.1.4 Risiko Perbankan	16
2.1.5 Risiko Kredit.....	17
2.1.6 Risiko Pasar	18

2.1.7	Risiko Likuiditas	19
2.1.8	Analisis Deret Waktu	20
2.1.9	Model ARIMA	20
2.1.10	Penelitian terdahulu	23
2.2	Kerangka Pemikiran	32
2.2.1	Analisis Risiko Kredit Bank Umum BUMN	32
2.2.2	Analisis Risiko Pasar Bank Umum BUMN	32
2.2.3	Analisis Risiko Likuiditas Bank Umum BUMN	33
2.3	Hipotesis Penelitian	34
BAB III	35
3.1	Jenis Penelitian	35
3.2	Operasionalisasi Variabel	35
3.3	Tahapan Penelitian	37
3.4	Populasi dan Sampel	38
3.4.1	Populasi	38
3.4.2	Sampel	38
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data	39
3.6	Teknik Analisis Data	39
3.6.1	Statistik Deskriptif dan Analisis Deret Waktu	39
BAB IV	45
4.1	Data Deskriptif	45
4.2	Hasil Pemodelan ARIMA	55
4.2.1	Uji Akar Unit Augmented Dickey-Fuller	55
4.2.2	Pengujian Differencing (Pembedaan)	56
4.2.3	Pemodelan ARIMA	56
4.2.4	Hasil Peramalan Model ARIMA	70
4.2.5	Pemodelan ARIMA rasio NPL, NIM, dan LDR	73
4.2.6	Tingkat Risiko rasio NPL, NIM, dan LDR	75
BAB V	80
5.1	Kesimpulan	80
5.2	Saran	82

DAFTAR PUSTAKA.....	84
Lampiran	87