

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
HALAMAN MOTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	10
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	10
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	10
1.4 Sistematika Penulisan.....	11
BAB II TELAAH PUSTAKA	13
2.1 Definisi	13
2.1.1 Industri Perbankan.....	13
2.1.2 Integrasi Sektor Perbankan.....	14
2.1.3 Pentingnya Pengukuran Integrasi Perbankan	15
2.1.4 Pendekatan Pengukuran Integrasi Perbankan	16
2.1.5 Konvergensi Tingkat Suku Bunga sebagai Pendekatan Pengukuran Integrasi Perbankan	17
2.1.6 <i>Central Bank Rate</i> sebagai Proksi Tingkat Suku Bunga Bank Suatu Negara	19
2.1.7 ASEAN +3 sebagai Gerakan Regional dalam Menyikapi Integrasi.....	20
2.2 Landasan Teori	22
2.2.1 Teori Integrasi	22
2.2.2 Kaitan Teori Paritas Suku Bunga dengan Integrasi.....	24
2.3 Penelitian Terdahulu.....	25
2.4 Kerangka Pemikiran	32

2.5	Hipotesis Penelitian	33
BAB III METODE PENELITIAN.....		36
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	36
3.1.1	Suku Bunga Bank Sentral.....	36
3.2	Populasi dan Sampel.....	37
3.2.1	Populasi	37
3.2.2	Sampel	37
3.3	Jenis dan Sumber Data	38
3.4	Metode Pengumpulan Data	38
3.5	Metode Analisis.....	39
3.5.1	<i>Vector Auto Regression (VAR)</i>	39
3.5.2	<i>Granger Causality Test</i>	41
3.5.3	<i>The Impulse Responses Function</i>	42
3.5.4	<i>The Cholesky Decomposition</i>	42
3.5.5	Tahapan Estimasi	43
3.5.5.1	Uji Stasioneritas	43
3.5.5.2	Penetapan Lag Optimal	45
3.5.5.3	Uji Kestabilan.....	45
3.5.5.4	Uji Kointegrasi ADF	46
3.5.5.5	Analisis VAR	46
3.5.5.6	Analisis VECM	47
3.5.5.7	Uji Kausalitas Granger	47
3.5.5.8	Analisis <i>Impulse Response</i>	49
3.5.5.9	Analisis <i>Variance Decomposition</i>	49
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		51
4.1	Deskripsi Obyek Penelitian	51
4.2	Analisis Data	53
4.2.1	Uji Kestasioneran	53
4.2.2	Uji Kointegrasi ADF	54
4.2.3	Penentuan Lag Optimal.....	55
4.2.4	Uji Kestabilan.....	58
4.2.5	Analisis VAR dengan VECM	59
4.2.6	Uji Kointegrasi Johansen	59
4.2.7	Hasil Analisis VAR dengan VECM.....	61
4.2.7.1	Uji <i>Granger Causality</i>	61
4.2.7.2	Simulasi <i>Impulse Response Function</i>	71
4.2.7.3	Analisis <i>Variance Decomposition</i>	81
4.3	Pembahasan	92
4.3.1	Pembahasan Hasil Uji Kausalitas Granger.....	92
4.3.2	Pembahasan Hasil IRF	97

4.3.3	Pembahasan Hasil <i>Variance Decomposition</i>	100
4.3.3	Penjelasan Menyeluruh Berdasarkan Pembahasan Hasil Uji Kausalitas Granger, IRF dan <i>Variance Decomposition</i>	103
BAB V PENUTUP.....		124
5.1	Simpulan.....	124
5.2	Keterbatasan Penelitian	125
5.3	Saran	126
DAFTAR PUSTAKA		128
LAMPIRAN – LAMPIRAN		132