

## Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan .....	ii
Halaman Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar .....	iv
Daftar Isi .....	v
Daftar Tabel .....	vii
Daftar Gambar.....	viii
Daftar Lampiran .....	ix
Daftar Singkatan .....	x
Intisati.....	xi
<i>Abstract</i> .....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Rumusan Masalah .....	2
1.3. Pertanyaan Penelitian .....	3
1.4. Tujuan Penelitian.....	3
1.5. Manfaat Penelitian.....	3
1.6. Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	3
1.7. Sistematika Penulisan.....	4
<b>BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>5</b>
2.1. Landasan Teori .....	5
2.2. Tinjauan Pustaka .....	6

BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....	10
3.1. Definisi Operasional Variabel .....	10
3.1.1. Perubahan <i>yield</i> obligasi pemerintah denominasi rupiah.....	10
3.1.2. Perubahan <i>yield</i> obligasi pemerintah denominasi dolar AS.....	10
3.1.3. Perubahan <i>rate</i> ICE LIBOR USD <i>Overnight</i> .....	11
3.1.4. Perubahan <i>yield</i> US <i>Treasury Note</i> 10Y .....	11
3.1.5. Perubahan kurs rupiah terhadap dolar AS.....	11
3.2. Populasi dan Sampel .....	12
3.3. Teknik Pengumpulan Data .....	12
3.4. Teknik Analisis Data .....	12
3.4.1. <i>Unit Root Test</i> .....	12
3.4.2. Pemilihan Model TAR .....	13
3.4.3. Pemilihan <i>Threshold</i> .....	13
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....	14
4.1. Deskripsi Data .....	14
4.2. Hasil <i>Unit Root Test</i> .....	15
4.3. Pembahasan .....	17
4.3.1. Efek Perubahan <i>Fed Fund Rate</i> .....	19
4.3.2. Efek Perubahan UST 10Y .....	20
4.3.3. Efek Perubahan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar AS.....	22
BAB V SIMPULAN .....	24
5.1. Simpulan.....	24
5.2. Keterbatasan .....	24
5.3. Implikasi .....	25
Daftar Pustaka .....	26
Lampiran .....	28