

Daftar Isi

| | |
|--|------|
| Halaman Judul..... | i |
| Halaman Pengesahan | ii |
| Halaman Pernyataan..... | iii |
| Kata Pengantar..... | iv |
| Daftar Isi..... | vi |
| Daftar Gambar..... | viii |
| Daftar Tabel..... | ix |
| Daftar Lampiran | x |
| Abstrak | xi |
| <i>Abstract</i> | xii |
| Bab 1 PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1. Latar Belakang..... | 1 |
| 1.2. Rumusan Masalah..... | 2 |
| 1.3. Pertanyaan Penelitian | 2 |
| 1.4. Tujuan Penelitian | 3 |
| 1.5. Metode Penelitian | 3 |
| 1.6. Manfaat Penelitian | 3 |
| 1.7. Lingkup Penelitian | 4 |
| 1.8. Sistematika Penulisan..... | 4 |
| Bab 2 KAJIAN PUSTAKA | 5 |
| 2.1. Landasan Teori..... | 5 |
| 2.2. Kerangka Teori <i>Stress Test</i> Ekonomi Makro | 9 |
| 2.3. Kerangka Konsep Penelitian..... | 10 |
| 2.4. Hipotesis..... | 11 |
| Bab 3 METODOLOGI PENELITIAN..... | 16 |
| 3.1. Jenis Penelitian..... | 16 |
| 3.2. Subyek Penelitian | 16 |
| 3.3. Data dan Metode Pengumpulan Data | 16 |
| 3.4. Metode Analisis Data..... | 19 |

| | | |
|----------------|---|----|
| Bab 4 | ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN..... | 28 |
| 4.1. | Risiko Kredit dan Ekonomi makro Indonesia | 28 |
| 4.2. | Uji Stasioneritas Data | 30 |
| 4.3. | Pemilihan <i>Lag</i> Optimal | 31 |
| 4.4. | Stabilitas Model VAR | 32 |
| 4.5. | Uji Kointegrasi | 33 |
| 4.6. | Uji Kausalitas | 36 |
| 4.7. | <i>Vector Error Correction Model</i> | 38 |
| 4.8. | <i>Analisis Impulse Response Function</i> | 50 |
| 4.9. | <i>Analisis Variance Decomposition</i> | 55 |
| Bab 5 | KESIMPULAN DAN SARAN..... | 59 |
| 5.1. | Kesimpulan..... | 59 |
| 5.2. | Keterbatasan | 60 |
| 5.2. | Implikasi..... | 60 |
| 5.3. | Keterbatasan | 61 |
| Daftar Pustaka | | 62 |
| Lampiran | | i |