

Pengukuran efisiensi perbankan dengan menggunakan pendekatan data envelopment analysis (DEA) dan pengaruh efisiensi perbankan terhadap stock return pada bank umum konvensional yang terdaftar di bursa efek Indonesia periode 2005-2010

Fitria Maharani, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20290560&lokasi=lokal>

Abstrak

Industri perbankan sebagai lembaga intermediasi memegang peranan sangat penting bagi pertumbuhan ekonomi Indonesia. Salah satu parameter kinerja perbankan yang telah dikembangkan sebelumnya adalah efisiensi. Pengukuran efisiensi perbankan sangat dibutuhkan dalam meneliti dan mengukur kinerja suatu bank. Bank yang efisien adalah bank yang profitable dan menghasilkan return yang besar untuk pemegang saham.

Penelitian ini bertujuan untuk mengukur efisiensi bank dan mengetahui pengaruh efisiensi terhadap stock return bank di Indonesia periode 2005-2010. Sampel penelitian ini adalah 19 bank umum konvensional yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Metode yang digunakan untuk mengukur efisiensi bank adalah metode non-parametrik Data Envelopment Analysis (DEA). Metode Pooled Least Squared (PLS) digunakan untuk mengetahui pengaruh efisiensi bank terhadap stock return.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa 19 bank umum konvensional selama 2005-2010 relatif efisien. Tahun 2005 hingga 2007, rata-rata score efisiensi cenderung naik. Rata-rata score efisiensi dari tahun 2008 hingga 2010 terjadi penurunan, namun efisiensi bank tahun 2010 masih lebih baik dibandingkan dengan tahun 2009. Hasil penelitian lainnya menunjukkan bahwa score efisiensi bank, yang diperoleh dari pendekatan DEA, tidak berpengaruh secara signifikan terhadap stock return bank.

.....The banking industry as an intermediary institutions play a pivotal role for Indonesia's economic growth. One of the banking performance parameters that have been developed earlier is the efficiency. Measurement of the efficiency of banking is needed in researching and measuring the performance of a bank. Banks that are efficient should be profitable and generate greater shareholder returns.

This research aims to measure the efficiency of the banks and determine the effect of efficiency on the stock return of banks in Indonesia between 2005-2010. Research samples are 19 conventional commercial banks listed on the Indonesia Stock Exchange. The method used to measure the efficiency of the bank is a non-parametric method Data Envelopment Analysis (DEA). Pooled Least Squared (PLS) method is used to determine the effect of bank efficiency on stock return.

The result of this research indicates that 19 conventional commercial banks during 2005-2010 are relatively efficient. In 2005 to 2007, the average efficiency scores tend increase. The average efficiency scores from 2008 to 2010 show a decrease, but the efficiency of banks in 2010 is still better than the year 2009. The result of this research also shows that the efficiency score of banks, which is obtained from DEA approach, does not significantly influence the bank's stock return.