

Faktor-faktor yang mempengaruhi besarnya suku bunga pada pasar uang antar Bank Indonesia periode 2015-2017, suatu kajian tentang konsentrasi dana pihak ketiga = The factors affecting interest rate in interbank money market period 2015-2017 concentration, study on third party fund

Sandi Wibisono, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20467793&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK
Penelitian ini dilakukan dengan tujuan untuk menguji hubungan antara konsentrasi Dana Pihak Ketiga DPK pada Bank ABCD Bank-Bank BUKU IV di Indonesia terhadap besarnya Suku Bunga pada Pasar Uang Antar Bank PUAB di Indonesia pada tenor ON overnight , satu minggu 1Wk , dua minggu 2Wk dan satu bulan 1Mo . Penelitian ini menggunakan data harian dengan periode penelitian 2015 ndash; 2017. Perhitungan konsentrasi DPK menggunakan Hirschman-Herfindahl Index HHI dan Concentration Ratio untuk empat Bank CR4 . Dari hasil penelitian didapatkan bahwa konsentrasi DPK pada Bank ABCD mempengaruhi secara signifikan pembentukan suku bunga PUAB pada tenor 1 bulan 1Mo , sedangkan pada tenor ON dan 1Wk lebih dipengaruhi oleh Proyeksi Likuiditas Harian PLH . Besarnya Suku Bunga pada hari sebelumnya berpengaruh signifikan pada seluruh tenor dalam penelitian ini, yakni tenor ON, 1Wk dan 2Wk serta pada tenor 1Mo.<hr />This paper aimed to test the relation between Third Party Fund TPF Concentration on Bank ABCD BUKU IV Banks in Indonesia and the level of interest rate in Interbank Money Market in Indonesia for tenor ON overnight , one week 1Wk , two weeks 2Wk and one month 1Mo . This study was used daily data for period 2015 ndash 2017. The concentration calculation employed Hirschman Herfindahl Index and Concentration Ratio for four Banks CR4 . The result showed that there is significant positive relation between the TPF concentration and the formation of interest rate for tenor 1Mo, while for tenor ON and 1Wk more affected significantly by Daily Liquidity Projection PLH . The interest rate that had been transacted on the previous day affects significantly to all tenor in this research, ON, 1Wk, 2Wk and tenor 1Mo.