

Mengukur Kontribusi Komponen CAMEL terhadap Risiko Sistemik Bank: Bukti dari Negara-Negara ASEAN-5 = Measuring the CAMEL Components Contribution towards Bank Systemic Risk: Evidence from ASEAN-5 Countries

Muhammad Adriansyah, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20507427&lokasi=lokal>

Abstrak

Peran indikator kesehatan keuangan menjadi semakin penting dalam mengarahkan pengawasan mikroprudensial terhadap risiko sektor perbankan, terutama di tengah perlambatan ekonomi global belakangan ini. Untuk menguji pentingnya indikator tersebut, penelitian ini mencoba mengukur kontribusi komponen CAMEL terhadap risiko sistemik (SRISK). Dengan menggunakan estimasi Feasible Generalized Least Square (FGLS) dan fixed-effect, dengan memanfaatkan data level bank terdaftar individu di negara-negara ASEAN-5 dari tahun 2004 hingga 2017, studi ini menemukan bahwa empat dari lima komponen CAMEL dan beberapa variabel makroekonomi dapat mempengaruhi risiko sistemik bank.

.....

The role of financial soundness indicators has become increasingly important in guiding the microprudential supervision towards banking sector risk, especially amidst the recent global economic slowdown. To examine the importance of the indicators, this study tries to measure the contribution of CAMEL components towards systemic risk (SRISK). Using the Feasible Generalized Least Square (FGLS) and fixed-effect estimations, leveraging individual listed bank level data in ASEAN-5 countries from 2004 to 2017, this study found that four out of five CAMEL components and some macroeconomic variables could affect the systemic risk of a bank.