

Pasar uang antar bank, pasar saham dan risiko bank yang terdapat pada bursa saham ASEAN-5 periode 2008-2017 = Interbank market, stock market and bank performance in Southeast Asia for the period 2008-2017

Aqilah Khairunisa, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20490996&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh risiko bank terhadap perubahan jumlah pinjaman antar bank, tingkat suku bunga pinjaman antar bank, serta imbal hasil saham bank. Sumber data yang digunakan berasal dari industri perbankan di lima negara di Asia Tenggara yaitu Indonesia, Malaysia, Singapura, Thailand, dan Filipina. Penelitian ini menggunakan metode panel dengan data tahunan selama 10 tahun yaitu pada periode 2008-2019. Metode regresi menggunakan regresi panel dengan random effect dan pooled least squares. Hasil penelitian menunjukkan bahwa risiko bank mempengaruhi tingkat pinjaman antar bank, tingkat suku bunga pinjaman antar bank, dan tingkat imbal hasil saham bank. Hal tersebut menunjukkan bahwa pasar uang dan pasar saham dapat berperan dalam membangun sistem perbankan yang sehat melalui efek disiplin pasar.

<hr>

The research aims to investigate the impact of bank risk on the rate change in interbank borrowing, interbank borrowing interest rates, and stock return. The data sources that used on this research are come from banking industry in five countries across South East Asia such as Indonesia, Malaysia, Singapore, Thailand, and Philippine. This study uses a panel method with annual data for 10 years, within the period of 2008-2019. This paper employes panel regression technique with random effect model and pooled least squares model. Researchs finding suggests that bank risk and performance influenced interbank borrowing, interbank borrowing rate and banks stock return. These findings imply that improving both the interbank market and the stock market may play a role in establishing a sound banking system through market discipline effects.