

Pengaruh Kompetisi Padar terhadap Risiko Sistemik Bank Di Asean-6 Periode 2005-2018 = Analysis of Bank Competition on Banking Systemic Risk (Case of ASEAN Banking Industry 2005-2018)

Andrew Deni Yonathan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20507351&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini menjelaskan mengenai pengaruh tingkat kompetisi pasar terhadap risiko sistemik pada perusahaan perbankan yang terdaftar di pasar modal di negara Indonesia, Malaysia, Filipina, Singapura, Thailand, dan Vietnam pada tahun 2005-2018. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini mencakup 798 observasi yang melibatkan 57 perusahaan dalam waktu 14 tahun. Pengujian hipotesis guna menentukan pengaruh tingkat kompetisi pasar terhadap risiko sistemik dilakukan dengan menggunakan metode regresi data panel fixed-effect dan random-effect. Hasil penelitian berikut menunjukkan bahwa tingkat kompetisi (Lerner Index, Herfindahl-Hirschman Index, H-Statistic, Boone Indicator, 5-Concentration Ratio, dan Net Interest Margin) yang rendah akan diikuti dengan paparan risiko sistemik (Systemic Risk Index dan Long Run Marginal Expected Shortfall) yang semakin meningkat.

<hr>

<i>ABSTRACT</i>

Bank Competition and Systemic Risk have become long-debated research issues among researchers. Researchers are trying to continue to explicate the impact of bank competition on bank systemic risk. In this paper, we examine the empirical relationship between competition and systemic risk by using the case of Indonesia, Malaysia, Philipine, Singapore, Thailand, and Vietnam regional banking system in 2005-2018. We find that competition proxies tend to escalate the regional-wide banking systemic risk. We demonstrate the hypothesis testing regarding the impact of competition on banking systemic risk by using fixed-effect panel and random-effect panel regression model. </i>