

## Analisis risiko contagion antar sistem perbankan pada negara-negara Asean-5 periode 2000-2012 = Analysis of contagion risk between banking systems of Asean 5 countries during 2000 2012

Fariz Rahmanto, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20431148&lokasi=lokal>

---

### Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh integrasi sistem perbankan terhadap kemungkinan terjadinya penularan risiko likuiditas antar sistem perbankan pada periode 2000-2012. Dengan menggunakan metode regresi spasial untuk melihat pengaruh sistem perbankan di suatu wilayah terhadap sistem perbankan di wilayah lainnya, hasil penelitian ini membuktikan bahwa probabilitas kebangkrutan suatu sistem perbankan secara signifikan berpengaruh positif terhadap probabilitas kebangkrutan sistem perbankan lain. Apabila terjadi kekurangan likuiditas pada salah satu sistem perbankan pada sistem yang terintegrasi maka hal tersebut dapat menyebabkan masalah likuiditas sistem lainnya. Selain itu penelitian ini juga membuktikan bahwa suatu sistem perbankan dapat meningkatkan stabilitasnya apa bila ia dengan sistem perbankan yang lebih stabil.

<hr>

This research aims to determine the effect of banking system integration against probability of liquidity risk transmission across banking systems during 2000-2012. By using Spatial Regression to see how a region's banking system might affect other regions' banking systems, this research has proven that a banking system's probability of bankruptcy significantly affects other banking systems' probability of bankruptcy. Liquidity shortage of a certain banking system that is integrated to other banking systems, can cause liquidity shortage to the other banking systems as well. In addition, this study has also proven that a banking system can increase its stability by being connected to a more stable banking system.