

Systemically important financial institutions sifi pada perbankan indonesia: pendekatan network analysis = Systemically important financial institutions sifi in indonesian banking network analysis approach

Anggayasti Hayu Anindita, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20456085&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk melakukan pengukuran risiko sistemik dengan menggunakan metode network analysis untuk mendapatkan peringkat SIFI bank-bank di Indonesia. Dengan menggunakan data penempatan antar bank periode tahun 2011 sampai dengan tahun 2015, secara empiris ditemukan bahwa interkoneksi pasar uang antar bank semakin meningkat. Namun demikian kondisi yang signifikan berbeda terjadi pada tahun 2013, di mana pola interkoneksi jaringan antar bank mengalami penurunan dibandingkan dengan tahun sebelumnya. Dilihat dari nilai degree centrality, bank-bank yang dimiliki oleh pemerintah dan swasta nasional cenderung bersifat in-degree. Kondisi yang berbeda ditunjukkan oleh bank swasta asing, di mana sebagian besar cenderung bersifat out-degree. Selain itu, bank yang memiliki nilai betweenness centrality yang tinggi cenderung akan memiliki nilai closeness centrality yang tinggi pula.

ABSTRACT

This study aimed at measuring systemic risks using network analysis method to obtain the SIFI rating of banks in Indonesia. Using the 2011 2015 interbank placement data, it is empirically found thon interbank money market interconnection increased. However, a significantly different condition was found in 2013 in which the interbank network interconnection pattern went downwards compared to the previous year. From the degree centrality score, government owned and national private banks tend to be in degree while foreign private banks tend to be out degree. In addition, bank with higher betweenness centrality score will have higher closeness centrality score as well.