

Pengaruh Ukuran Bank dan Kompleksitas Bank terhadap Risiko Sistemik Bank di Indonesia pada Periode 2004-2018 = The Effect of Bank Size and Bank Complexity on Bank Systemic Risk in Indonesia from 2004-2018

Rezza Aldan Benaldi, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20504483&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh ukuran bank dan kompleksitas bank terhadap risiko sistemik. Penelitian ini menggunakan sampel berasal dari 27 bank di Indonesia yang terdaftar pada bursa efek dalam kurun waktu 2004-2018. Jenis data yang digunakan adalah unbalance panel data yang diolah menggunakan regresi panel data fixed effect. Risiko sistemik menggunakan dua pengukuran berbeda yaitu CoVaR dan SRISK. Dari penelitian ini dihasilkan temuan berupa ukuran bank memiliki pengaruh pada risiko sistemik di mana pada pengaruh positif terhadap SRISK dan pengaruh negatif pada CoVaR. Selain itu, kompleksitas juga berpengaruh negatif pada risiko sistemik bank di Indonesia. Sedangkan tidak ditemukan pengaruh interaksi antara ukuran bank dan kompleksitas bank terhadap risiko sistemik

.....This study aims to analyze the effect of bank size and bank complexity on systemic risk. This study uses samples from 27 commercial banks in Indonesia which are listed on the stock exchange in the period 2004-2018. The type of data used is unbalanced panel data that is processed using fixed effect panel data regression. Systemic risk uses two different measurements namely CoVaR and SRISK. From this research, bank size influences systemic risk, where the positive effect on SRISK and the negative effect on CoVaR. Besides, complexity also negatively affects the systemic risk of banks in Indonesia. While no interaction effect was found between bank size and bank complexity on systemic risk.