

Inhaltsverzeichnis

Inhaltsverzeichnis.....	VII
Abbildungsverzeichnis	IX
Tabellenverzeichnis.....	XI
Abkürzungsverzeichnis	XIII
Symbolverzeichnis	XVII

1. Einführung	1
----------------------------	----------

2. Grundlagen zum Liquiditätsrisiko	5
--	----------

2.1. Begriffliche Bestimmungen.....	5
2.1.1. Definition Risiko.....	5
2.1.2. Definition Liquidität	7
2.1.3. Bankspezifische Liquidität.....	9
2.1.4. Liquiditätstheorien	11
2.2. Differenzierung der Liquiditätsrisiken	15
2.2.1. Ableitung einer Liquiditätsrisiko-Definition	15
2.2.2. Objekt- und bankbezogenes Liquiditätsrisiko	16
2.2.3. Originäres und derivatives Liquiditätsrisiko.....	17
2.2.4. Dispositives und strukturelles Liquiditätsrisiko.....	19
2.3. Moderne Konzepte zur Messung des Liquiditätsrisikos.....	20
2.3.1. Liquiditätsablaufbilanz	20
2.3.2. Liquidity at Risk	23
2.3.3. Expected Liquidity at Risk.....	26
2.3.4. Liquidity Value at Risk.....	27
2.3.5. Stresstests	29

3. Auswirkungen der Finanzkrise auf die Banken in Bezug auf die Liquidität	33
---	-----------

3.1. Entwicklung der Finanzkrise.....	33
3.1.1. Ursachen der Subprime-Krise.....	33
3.1.2. Von der Subprime-Krise zur Finanzkrise	41
3.1.3. Von der Bonitätskrise zur Liquiditätskrise	43

3.2. Folgen der Finanzkrise	48
3.2.1. Auf die internationale Realwirtschaft	48
3.2.2. Auf den Bankensektor	50
3.2.3. Auf die Liquidität der Banken	51
3.3. Lehren aus der Finanzkrise	54
3.3.1. Vermeidung zukünftiger Finanzmarktkrisen	54
3.3.2. Auswirkungen auf die Regulierungsvorschriften	56
 4. Künftige Regulierungsvorschriften zur Verbesserung der Liquiditätssituation in der Bankenbranche	59
4.1. Vorschriften	59
4.1.1. Geltende Liquiditätsverordnung-LiqV	59
4.1.2. Die neuen MaRisk	61
4.1.3. Die neuen Baseler Liquiditätsanforderungen	64
4.2. Erwartungen bzw. Auswirkungen	71
4.2.1. Erwartungen an die künftigen Regulierungsvorschriften	71
4.2.2. Mögliche Auswirkungen	73
4.3. Kritische Würdigung	74
4.3.1. Chancen der künftigen Regulierungsvorschriften	74
4.3.2. Risiken der künftigen Regulierungsvorschriften	75
 5. Schlussbetrachtung	77
 Anhang	81
Literaturverzeichnis	87
Internetquellenverzeichnis	97

<http://www.springer.com/978-3-658-00805-5>

Das Liquiditätsrisiko der Banken in der Finanzkrise
Künftige Regulierungsvorschriften und ihre
Auswirkungen

Seel, G.

2013, XVIII, 97 S. 14 Abb., Softcover

ISBN: 978-3-658-00805-5