

Tato studie hodnotí dopad regulatorního rámce „Basilej III“ na mezibankovní nákazu. Studie se zaměřuje na přímou mezibankovní nákazu šířící se skrze mezibankovní zahraniční pohledávky mezi národními bankovními sektory. Síťový model založený na rozvahách bankovních sektorů využívá čtvrtletní konsolidované bankovní statistiky shromažďované Bank for International Settlements k simulaci úvěrového šoku a šoku financování za nepříznivých tržních podmínek. V porovnání s „Basilejí II“ regulatorní rámec „Basilej III“ snižuje pravděpodobnost mezibankovní nákazy (následující po simulované insolvenční jedné bankovního sektoru) z 31 % na 14 % a snižuje dopad nákazy o 63 % měřeno průměrnou ztrátou bankovního sektoru. Simulace při obou regulatorních rámcích ukázaly, že i poměrně malé bankovní sektory mohou vyvolat závažnou nákazu porovnatelnou s velkými bankovními sektory. Během období 2005 až 2009 stabilizoval regulatorní rámec „Basilej III“ výkyvy v rozsahu mezibankovní nákazy.