

Abstrakt

Tato práce zkoumá dopad kapitálových požadavků na tvorbu likvidity bank zemí GIIPS mezi lety 2006-2016. Výsledky jsou odhadnuty analýzou panelových dat za pomocí modelu Fixního efektu a 2SLS regresní metody.

Výsledky ukazují, že existuje negativní vztah mezi kapitálovými požadavky a tvorbou likvidity. Slouží tak jako podpora tvůrcům Basel III/CRD IV, při posuzování dopadů zavedení vyšších kapitálových požadavků. Dále bylo zjištěno, že velikost banky je negativně korelována s tvorbou likvidity a že finanční krize má vliv na významnost vztahu mezi kapitálovými požadavky a tvorbou likvidity. Přesto navrhuje, aby nové polštáře likvidity a kapitálové požadavky byly doprovázeny ostatními nástroji, z důvodu zajištění stabilního finančního systému v zemích GIIPS.

Klasifikace	E58,F33, G21, G28
Klíčová slova	Kapitálové požadavky, Tvorba likvidity, Bankovní regulace, Fixní efekt
E-mail autora	gladiolagjuzi@hotmail.com
E-mail vedoucího práce	ztuma@kpmg.cz

