

Inhaltsverzeichnis

Abbildungsverzeichnis.....	x
Abkürzungsverzeichnis	xi
Zusammenfassung.....	xv
Summary.....	xvi
1. EINLEITUNG.....	1
1.1 Problemstellung.....	1
1.2 Forschungsdesign.....	3
1.2.1 <i>Forschungsziel</i>	3
1.2.2 <i>Forschungsfragen</i>	4
1.2.3 <i>Wissenschaftlicher Kontext</i>	4
1.3 Aufbau	5
2. KOSTEN-/NUTZENANALYSE IN DER FINANZMARKTREGULIERUNG	9
2.1 Grundlagen.....	9
2.1.1 <i>Finanzmarktregulierung</i>	9
2.1.2 <i>Regulierungstheorien</i>	10
2.1.3 <i>Kosten-/Nutzenanalyse</i>	13
2.2 Literaturüberblick	15
2.2.1 <i>Theoretische Beiträge</i>	15
2.2.2 <i>Empirische Untersuchungen</i>	20
2.3 Ausgewählte Praxisbeispiele.....	23
2.3.1 <i>Überblick</i>	23
2.3.2 <i>CBA-Modell der Financial Services Authority</i>	26
2.4 Regulierung des schweizerischen Bankensektors.....	30
2.4.1 <i>Der schweizerische Bankensektor</i>	30
2.4.2 <i>Regulatorische Ausgangslage</i>	32
2.4.3 <i>Praxis der Regulierungsfolgenabschätzung</i>	35
2.4.4 <i>Verankerung der Kosten-/Nutzenanalyse</i>	37
2.5 Kritische Würdigung	41

3. ENTWICKLUNG EINER REGULATORY SCORECARD (RSC-MODELL)	45
3.1 Modellanforderungen	45
3.1.1 <i>Best Practices der OECD</i>	45
3.1.2 <i>Kosten-/Nutzenanalysen im Regulierungsprozess</i>	46
3.1.3 <i>Anforderungen an das RSC-Modell</i>	52
3.2 Modellbausteine	59
3.2.1 <i>Kosten- und Nutzenfunktionen der Finanzmarktregulierung</i>	59
3.2.2 <i>Methoden zur Erfassung von Kosten- und Nutzeneffekten</i>	64
3.2.3 <i>Direkte und indirekte Messkonzepte zur Kosten-/Nutzenanalyse</i>	70
3.2.4 <i>Kosten-/Nutzenanalysen im Systemkontext</i>	75
3.2.5 <i>Kosten-/Nutzenanalysen im Lichte scorecard-basierter Modellansätze</i>	82
3.3 Modellentwicklung	88
3.3.1 <i>Regulatory Scorecard</i>	88
3.3.2 <i>Herleitung des RSC-Modells</i>	94
3.4 Modellanwendung	101
4. ANWENDUNG DES RSC-MODELLS AM BEISPIEL VON BASEL II	105
4.1 Die Neue Basler Eigenkapitalvereinbarung (Basel II)	105
4.2 Illustration der Modellanwendung	111
4.2.1 <i>Festlegung des Analyserahmens</i>	111
4.2.2 <i>Identifikation der Schlüsselfaktoren</i>	117
4.2.3 <i>Analyse systemischer Wirkungsgefüge</i>	128
4.2.4 <i>Definition der Indikatoren</i>	136
4.2.5 <i>Zuordnung der Gewichtungsfaktoren</i>	146
4.2.6 <i>Herleitung der Ratings</i>	156
4.2.7 <i>Illustration der Ergebnisse</i>	179
4.3 Ausblick	183
5. SCHLUSSBETRACHTUNG	187
5.1 Kritische Beurteilung des RSC-Modells	187
5.2 Implementierungsempfehlungen	194
5.3 Fazit	198
Literaturverzeichnis	203
Internetverzeichnis	224