

PROGRAMM



zum Workshop 'Kreditrisikomanagement', Obergurgl 2005

>> Freitag, 25.November				
session	Zeit	Titel	Autoren	Institution
1	13.15 - 13.45	Time to Change. Rating Changes and Policy Implications	Peter Posch	Uni Ulm
	13.45 - 14.15	Strategisches Kreditnehmerverhalten im ratingbasierten Kreditschäft	Friedrich Thießen	TU Chemnitz
14.15 – 14.30 <i>Pause</i>				
2	14.30 - 15.00	Explaining the CDS Basis	Rainer Jankowitsch, Rainer Pullirsch, Tanja Veža	WU Wien
	15.00 - 15.30	Risk Transfer with CDO	Christian Wilde, Jan Pieter Krahenen	Uni Frankfurt
15.30 – 16.00 <i>Kaffeepause</i>				
3	16.00 - 16.30	Keynote Lecture	Wolfgang Bühler	Uni Mannheim
	16.30 - 17.00	Investment Timing and Endogenous Default	Stefan Hirth	Uni Karlsruhe
17.00 – 17.15 <i>Pause</i>				
4	17.15 - 17.45	Loss Given Default: Ein Ansatz zur Point in Time Modellierung	Alfred Hamerle, Michael Knapp, Nicole Wildenauer	Uni Regensburg
	17.45 - 18.15	Gemeinsame Ausfallwahrscheinlichkeiten von österr. KMU	Michael Jeckle, Robert Schwarz	FH des bfi Wien
<i>Abendessen</i>				



>> Samstag, 26. November				
session	Zeit	Titel	Autoren	Institution
5	9.00 - 9.30	Die Konsistenz von Ratingsystemen – Alternative Verfahren der Validierung auf Basis eines Benchmarkings	Gerhard Winkler	ÖNB
	9.30 - 10.00	Maturity Effect on Risk Measure in a Ratings-Based Default-Mode Model	Dirk Heithecker	TU Braunschweig
10.00 – 10.15 <i>Pause</i>				
6	10.15 - 10.45	Der ökonomische Wert von Ratingsystemen	Stefan Pichler	WU Wien
	10.45 - 11.15	Regulatory Banking Capital, Estimation Error, and Systemic Risk in Ratings Based Capital Rules	Daniel Rösch	Uni Regensburg
11.15 – 11.30 <i>Pause</i>				
7	11.30 - 12.00	Modelling Simultaneous Defaults and Valuation of Defaultable Securities	Michael Kunisch	Uni Karlsruhe
	12.00 - 12.30	Analysis of Copula-Functions and Applications to Credit Risk Management	Philipp Koziol, Michael Kunisch	WHU, Uni Karlsruhe