

PROGRAMM

Obergurgl - 02.-04. April 2009

Workshop

Risikomanagement

Universität Innsbruck - Obergurgl - 2009



>> Donnerstag, 02.April				
session	Zeit	Titel	Autoren	Institution
	17.00 - 17.15	Begrüßung		
	17.15 - 18.15	Keynote	Stefan Pichler.	WU Wien
<i>Gemeinsames Abendessen (auf Einladung der Veranstalter)</i>				
1	20.00 - 20.30	<i>„Financing Investment: The Cost Trade-Off“</i>	Flor, C.R. und S. Hirth	U. Aarhus
	20.30 - 21.00	<i>“Accounting-Informationen und credit spreads“</i>	Kunisch, M.	U.Karlsruhe
	21.00 - 21.30	<i>“Price Dispersion in OTC Markets: A New Measure of Liquidity“</i>	R.Jankowitsch, A.Nashikkar, M.G.Subrahmanyam	WU Wien, Stern School NYU
>> Freitag, 03.April				
2	16.30 - 17.00	Trading Financial Markets with Online Algorithms	Mohr, E. und G. Schmidt	U.Saarland
	17.00 - 17.30	Risks of private equity fund-of-fund investment: A detailed cash flow-based approach	Achleitner, A.-K., R. Braun, M. Schaller und F. Tappeiner	TU München
<i>Abendessen</i>				

3	20.00 - 20.30	<i>„A Latent Variable Approach to Validate Credit Rating Systems“</i>	Hornik, K, R. Jankowitsch, C. Leitner, M. Lingo, S. Pichler und G. Winkler	WU Wien
	20.30 - 21.00	<i>„Extending the Latent Variable Approach to Rating Model Validation - Including Finite Mixture Distributions and Censored Observations“</i>	Grün, B., P. Hofmarcher, K.Hornik, C. Leitner und S. Pichler	WU Wien
	21.00 - 21.30	<i>„Bayesian Inference for a Dynamic Latent Variable Approach“</i>	Grün, B., P. Hofmarcher, K.Hornik, C. Leitner und S. Pichler	WU Wien
>> Samstag, 04.April				
4	09.00 - 09.30	<i>„Berücksichtigung von Schätzunsicherheit bei der Kreditrisikobewertung“</i>	Dannenberg, H.	IWH Halle
	09.30 - 10.00	<i>“The Empirical Relation between Credit Quality, Recoveries, and Correlation in a Simple Credit Risk Model”</i>	Rösch, D. und H. Scheule	U. Hannover/ U.of Melbourne
5	10.30 - 11.00	<i>„Why and How to Integrate Liquidity Risk into a VaR-Framework“</i>	Stange, S. und C. Kaserer	TU München
	11.00 - 11.30	“tba”	Kunisch, M. und S. Sarbu	U.Karlsruhe