

8. Dresdner Risikotutorium (22.-23. 6. 2006)

Das Programm

Donnerstag, 22. Juni 2006

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.05 Kreditrisiko und Kreditstrategie
(T. Ridder, H. Sauereisen)
- 16.05 Kaffeepause
- 16.30 Integration von Risikoarten im Top-Down-Approach
(L. Overbeck)
- 17.30 Integration von Marktrisiken in Kreditportfoliomodelle
(P. Grundke)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 23. Juni 2006

- 9.30 Integration von Bankrisiken unter Berücksichtigung des Cash Flow Risikos:
Liquidity at Risk bankbetrieblicher Zahlungsströme
(S. Zeranski)
- 10.30 Empirische Kalibrierung von Kreditportfoliomodellen
(L. Hahnenstein)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Ökonomisches Kapital und Use-Test:
Bedeutung des ökonomischen Kapitals für die Zulassung von Ratingverfahren
(G. Stahl)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Risikomessung für strukturierte Kreditprodukte:
Chancen und Risiken von Approximationen
(R. Prinzler)

8. Dresdner Risikotutorium (22.-23. 6. 2006)

Die Referenten

- *Dr. Peter Grundke:*
Universität zu Köln
- *Dr. Lutz Hahnenstein:*
IKB Deutsche Industriebank AG, Düsseldorf
- *Prof. Dr. Ludger Overbeck:*
Justus-Liebig-Universität Gießen
- *Dr. Ralf Prinzler:*
KfW Bankengruppe, Frankfurt a. M.
- *Dr. Thomas Ridder:*
DZ BANK AG, Frankfurt a. M.
- *Holger Sauereisen:*
DZ BANK AG, Frankfurt a. M.
- *Gerhard Stahl:*
Regierungsdirektor, Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin), Bonn
- *Dr. Stefan Zeranski:*
Kölner Bank e. G.

Die Veranstalter

- *Prof. Dr. Stefan Huschens:*
Lehrstuhl für Quantitative Verfahren, insbesondere Statistik,
Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, TU Dresden
- *Prof. Dr. Hermann Locarek-Junge:*
Lehrstuhl für Betriebswirtschaftslehre,
insbesondere Finanzwirtschaft und Finanzdienstleistungen,
Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, TU Dresden

Der Ort

- *Schloß Eckberg* (www.schloss-eckberg.de)
- Unterbringung im *Kavaliershaus* (www.schloss-eckberg.de/kavalier.htm)
- Tagung in der Remise (www.schloss-eckberg.de/remise.htm)
- Mittag- und Abendessen im Schloß (www.schloss-eckberg.de/gastron.htm)
- Anfahrt mit Taxi vom Flughafen Dresden oder
per PKW (www.schloss-eckberg.de/lage.htm)