

Workshop Credit Risk Models

am Montag, dem 19. April 2004

Programm

9:00 – 9:05	Begrüßung
9:05 – 9:45	Reduced Form Models for Credit Risk – a Primer <i>Siegfried Trautmann, CoFaR</i>
9:45 – 10:45	Can Structural Models explain Prices of Sovereign Bonds? <i>Gordon Gemmill, City University London</i>
10:45 – 11:15	Pause
11:15 – 12:15	On Dynamic Models for Portfolio Credit Risk and Credit Contagion <i>Rüdiger Frey, Universität Leipzig</i>
12:15 – 14:00	Mittagspause
14:00 – 15:00	Determinants of the Asset Correlations of German Corporations and Implications for Regulatory Capital <i>Klaus Düllmann, Deutsche Bundesbank</i>
15:00 – 15:30	Pause
15:30 – 16:30	Parameterizing Credit Risk Models <i>Daniel Rösch, Universität Regensburg</i>
16:30 – 17:00	Assessing the Discriminatory Power of Credit Scores under Censoring <i>Marlene Müller, Fraunhofer ITWM</i>
ab 17:00	Ausklang mit Käse und Wein

Organisatorische Hinweise

Ort	Johannes Gutenberg-Universität, Mainz Haus Recht und Wirtschaft I (neu), Welderweg 9
Kosten	€ 200 (€ 50 für Universitätsangehörige) inkl. Tagungsunterlagen, Pausengetränken und Mittagessen
Anmeldung	Anmeldeformular unter www.cofar.uni-mainz.de/workshop2004.html
Information	Marita Lehn, CoFaR Center of Finance and Risk Management, Telefon 06131/39-2 37 61, Telefax 06131/39-2 37 66 E-Mail-Adresse: info@cofar.uni-mainz.de

CoFaR
Johannes Gutenberg-
Universität Mainz
D-55099 Mainz

Tel.: 0 61 31 / 39-2 37 61
Fax: 0 61 31 / 39-2 37 66

www.cofar.uni-mainz.de
info@cofar.uni-mainz.de