

Dresdner Risikotutorium (DRT)

Veranstalter

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

Bisherige Veranstaltungen

- 11. Dresdner Risikotutorium (DRT11): 4.-5. 7. 2013
- 10. Dresdner Risikotutorium (DRT10): 14.-15. 10. 2010
- 9. Dresdner Risikotutorium (DRT9): 23.-24. 10. 2008
- 8. Dresdner Risikotutorium (DRT8): 22.-23. 6. 2006
- 7. Dresdner Risikotutorium (DRT7): 2.-3. 6. 2005
- 6. Dresdner Risikotutorium (DRT6): 13.-14. 5. 2004
- 5. Dresdner Risikotutorium (DRT5): 15.-16. 5. 2003
- 4. Dresdner Risikotutorium (DRT4): 16.-17. 5. 2002
- 3. Dresdner Risikotutorium (DRT3): 7.-8. 9. 2000
- 2. Dresdner Risikotutorium (DRT2): 16.-17. 9. 1999
- 1. Dresdner Risikotutorium (DRT1): 6.-7. 3. 1998

Referenten des DRT1 bis DRT11

Dr. C. Bluhm • Prof. Dr. H. W. Brachinger • Prof. Dr. R. Frey • Dr. U. Gaumert • Dr. R. Goebel • Prof. Dr. P. Grundke • Dr. W. Gothein • Dr. H. Haaf • Dr. J. Hanisch • Dr. L. Hahnenstein • Dr. A. Henking • Prof. Dr. S. Höse • Prof. Dr. S. Huschens • Prof. Dr. L. Johanning • Prof. Dr. G. Löffler • Dr. A. Mitropoulos • W. Mussil • Prof. Dr. A. Oehler • Prof. Dr. L. Overbeck • Prof. Dr. N. Packham • Dr. R. Prinzler • Dr. O. Ranné • Dr. T. Ridder • Prof. Dr. D. Rösch • Prof. Dr. P. Roßbach • H. Sauereisen • Prof. Dr. H. Scheule • Dr. R. Schmidt • Dr. G. Schröck • Prof. Dr. P. Sibbertsen • Dr. F. Spellmann • Prof. Dr. h.c. G. Stahl • Dr. D. Tasche • Prof. Dr. M. Wahrenburg • Prof. Dr. U. Walther • Dr. C. Wehn • Dr. U. Wehrspon • Dr. S. Zeranski

11. Dresdner Risikotutorium (4.-5. 7. 2013)

Das Programm

Donnerstag, 4. Juli 2013

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.05 Bepreisung systematischer Kreditrisiken
(Daniel Rösch)
- 16.05 Kaffeepause
- 16.30 Makroökonomische Kreditrisikoprognose – Analyse des europäischen Firmenkundenmarktes
(Andreas Henking, Walter Mussil)
- 17.30 Die Auswirkung von Netzwerk-Inhomogenität auf Ansteckungseffekte und Systemstabilität
(Ursula Walther)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 5. Juli 2013

- 9.30 Systemisches Risiko und Assetkorrelationen von Konsumentenkrediten
(Harald Scheule)
- 10.30 Ausfallwahrscheinlichkeiten unter Stress in Normal Variance Mixture Modellen
(Natalie Packham)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 „Halten oder Verkaufen“: Management eines Divestment-Buches
(Christian Bluhm)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Treasury-Management
(Ralf Goebel)

11. Dresdner Risikotutorium (4.-5. 7. 2013)

Die Referenten

- *Dr. Christian Bluhm*
FMS Wertmanagement, München
- *Dr. Ralf Goebel*
Deutscher Sparkassen- und Giroverband, Berlin
- *Dr. Andreas Henking*
Quantic Risk Solutions, Wien
- *Walter Mussil*
Quantic Risk Solutions, Wien
- *Prof. Dr. Natalie Packham*
Frankfurt School of Finance & Management
- *Prof. Dr. Daniel Rösch*
Universität Regensburg
- *Prof. Dr. Harald Scheule*
University of Technology, Sydney
- *Prof. Dr. Ursula Walther*
Hochschule für Wirtschaft und Recht, Berlin

Die Veranstalter

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

Der Ort

- *Schloss Eckberg* (www.schloss-eckberg.de)
- Unterbringung im *Kavaliershaus* (www.schloss-eckberg.de/index.php/das-kavaliershaus)
- Tagung in der Remise (www.schloss-eckberg.de/index.php/remise-tagungen)
- Mittag- und Abendessen im Schloss (www.schloss-eckberg.de/index.php/gastronomie)
- Anfahrt mit Taxi vom Flughafen Dresden oder
per PKW (www.schloss-eckberg.de/index.php/anfahrt)

10. Dresdner Risikotutorium (14.-15. 10. 2010)

Das Programm

Donnerstag, 14. Oktober 2010

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.05 Wie schlecht waren Ratings von Verbriefungen wirklich? Und warum?
Ergebnisse einer empirischen Studie
(Daniel Rösch)
- 16.05 Kaffeepause
- 16.30 Kreditrisikomodellierung im Nachgang der Krise neu reflektiert
(Christian Bluhm)
- 17.30 Modellrisiko und latente Risikofaktoren
(Steffi Höse)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 15. Oktober 2010

- 9.30 Modellrisiko bei der Fehlspezifikation ökonomischer Risiken
(Philipp Sibbertsen)
- 10.30 Validierung ökonomischer Szenario-Generatoren (*economic scenario generators*)
(Gerhard Stahl)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Modellrisiko bei Marktrisikomodellen
(Carsten Wehn)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Integration von Stresstests in ein Risikotragfähigkeitskonzept
(Jendrik Hanisch, Ralf Prinzler)

10. Dresdner Risikotutorium (14.-15. 10. 2010)

Die Referenten

- *Dr. Christian Bluhm*
FMS Wertmanagement, München
- *Dr. Jendrik Hanisch*
KfW Bankengruppe, Frankfurt a. M.
- *Dr. Steffi Höse*
Technische Universität Dresden
- *Dr. Ralf Prinzler*
KfW Bankengruppe, Frankfurt a. M.
- *Prof. Dr. Daniel Rösch*
Universität Hannover
- *Prof. Dr. Philipp Sibbertsen*
Universität Hannover
- *Prof. Dr. h. c. Gerhard Stahl*
Talanx, Hannover
- *Dr. Carsten Wehn*
DekaBank, Frankfurt a. M.

Die Veranstalter

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

Der Ort

- *Schloß Eckberg* (www.schloss-eckberg.de)
- Unterbringung im *Kavaliershaus* (www.schloss-eckberg.de > Kavaliershaus)
- Tagung in der Remise (www.schloss-eckberg.de > Remise / Tagungen)
- Mittag- und Abendessen im Schloß (www.schloss-eckberg.de > Gastronomie)
- Anfahrt mit Taxi vom Flughafen Dresden oder
per PKW (www.schloss-eckberg.de > Lage / Anfahrt)

9. Dresdner Risikotutorium (23.-24. 10. 2008)

Das Programm

Donnerstag, 23. Oktober 2008

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.05 Modellrisiko
(G. Stahl)
- 16.05 Kaffeepause
- 16.30 Sensitivitätsanalysen von CDOs
(D. Rösch)
- 17.30 Eigenschaften von Verbriefungsratings
(A. Mitropoulos)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 24. Oktober 2008

- 9.30 Kreditrisiko im Handelsbuch – Marktrisiko im Kreditbuch
(G. Schröck)
- 10.30 Die US-Subprime-Krise: Modell- und Systemversagen am Beispiel von CDO auf ABS
(R. Prinzler, O. Ranné)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Kreditrisikotransfer im genossenschaftlichen Finanzverbund:
Möglichkeiten und Grenzen in Zeiten der Finanzmarktkrise
(T. Ridder)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Schlußdiskussion zur Finanzmarktkrise

9. Dresdner Risikotutorium (23.-24. 10. 2008)

Die Referenten

- *Atanasios Mitropoulos:*
FitchRatings, London
- *Dr. Ralf Prinzler:*
KfW Bankengruppe, Frankfurt a. M.
- *Dr. Omar Ranné:*
KfW Bankengruppe, Frankfurt a. M.
- *Dr. Thomas Ridder:*
DZ BANK AG, Frankfurt a. M.
- *Prof. Dr. Daniel Rösch:*
Universität Hannover
- *Dr. Gerhard Schröck:*
Oliver Wyman GmbH, Frankfurt a. M.
- *Prof. Dr. h. c. Gerhard Stahl:*
Talanx, Hannover

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 > Kavaliershaus)
- Tagung in der Remise (www.schloss-eckberg.de > Remise / Tagungen)
- Mittag- und Abendessen im Schloß (www.schloss-eckberg.de > Gastronomie)
- Anfahrt mit Taxi vom Flughafen Dresden oder
per PKW (www.schloss-eckberg.de > Lage / Anfahrt)

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)

7. Dresdner Risikotutorium (2.-3. 6. 2005)

Das Programm

Donnerstag, 2. Juni 2005

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.10 Kreditportfoliomanagement - Die nächste Generation
(C. Bluhm)
- 16.10 Kaffeepause
- 16.40 Basel II erweitert: Das Basel-II-Kreditportfoliomodell mit mehr als einem systematischen Faktor
(D. Tasche)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 3. Juni 2005

- 9.30 Rating Through the Cycle: Was heißt das und wie kann man es validieren?
(G. Löffler)
- 10.30 Validierung von Ausfallwahrscheinlichkeiten und Kreditrisikomodellen
(U. Wehrspohn)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Zinsänderungsrisiko
(T. Ridder, G. Stahl)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Schlußdiskussion

7. Dresdner Risikotutorium (2.-3. 6. 2005)

Die Referenten

- *Dr. Christian Bluhm:*
Credit Suisse, Zürich
- *Prof. Dr. Gunter Löffler:*
Universität Ulm
- *Dr. Thomas Ridder:*
DZ BANK AG, Frankfurt a.M.
- *Gerhard Stahl:*
Regierungsdirektor, Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin), Bonn
- *Dr. Dirk Tasche:*
Deutsche Bundesbank, Frankfurt a.M.
- *Dr. Uwe Wehrspohn:*
Wehrspohn Risk Management GmbH & Co. KG, Eppingen

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)

6. Dresdner Risikotutorium (13.-14. 5. 2004)

Das Programm

Donnerstag, 13. Mai 2004

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.10 Pragmatische Kreditportfoliosteuerung
(T. Ridder)
- 16.10 Kaffeepause
- 16.40 Monitoring und Backtesting von Retail-Scoreverfahren
(A. Henking)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 14. Mai 2004

- 9.30 Value & Risk von Value @ Risk:
Die Herausforderungen bei der Umsetzung aufsichtsrechtlicher Anforderungen
(W. Gothein)
- 10.30 Kreditportfoliomodelle: Struktur, Kalibrierung und Modellrisiko
(R. Frey)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Basel II versus Solvency II: - wer lernt von wem?
(G. Stahl)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Schlußdiskussion

6. Dresdner Risikotutorium (13.-14. 5. 2004)

Die Referenten

- *Prof. Dr. Rüdiger Frey:*
Universität Leipzig
- *Dr. Werner Gothein:*
Value & Risk AG, Bad Homburg
- *Dr. Andreas Henking:*
RiskSIM, München
- *Dr. Thomas Ridder:*
DZ BANK AG, Frankfurt a.M.
- *Gerhard Stahl:*
Regierungsdirektor, Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)

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

5. Dresdner Risikotutorium (15.-16. 5. 2003)

Das Programm

Donnerstag, 15. Mai 2003

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.10 Risikoverträglichkeit
(R. Schmidt)
- 16.10 Kaffeepause
- 16.40 Bankenaufsicht und Steuerung
(G. Stahl)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 16. Mai 2003

- 9.30 Was ist Kreditportfoliomanagement?
(T. Ridder)
- 10.30 Analyse und Bewertung von Collateralized Debt Obligations
(C. Bluhm)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Korrelationen und makroökonomische Zyklen von Kreditrisiken –
Empirische Ergebnisse für Deutschland, Konsequenzen für PD-Prognosen,
Risikokapital und Backtesting
(D. Rösch)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Schlußdiskussion:
Zusammenschau der fünf Vorträge vor dem Hintergrund von Basel II, III, IV, ...

5. Dresdner Risikotutorium (15.-16. 5. 2003)

Die Referenten

- *Dr. Christian Bluhm:*
Group Credit Portfolio Management, HypoVereinsbank
- *Dr. Thomas Ridder:*
Risiko-Controlling, DZ BANK AG
- *Dr. Daniel Rösch:*
Universität Regensburg, Lehrstuhl für Statistik
- *Dr. Ralph Schmidt:*
Corporate Center / Konzernentwicklung, Bayerische Landesbank
- *Gerhard Stahl:*
Oberregierungsrat, Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BAFin), Bankenaufsicht

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.

4. Dresdner Risikotutorium (16.-17. 5. 2002)

Das Programm

Donnerstag, 16. Mai 2002

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer
- 15.10 Das Ratinggemeinschaftsprojekt der privaten Banken
(U. Gaumert)
- 16.10 Kaffeepause
- 16.40 Interne Ratingmodelle in der KfW
(R. Prinzler)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 17. Mai 2002

- 9.30 Chancen, Risiken und Nebenwirkungen quantitativer Ratingmodelle
(T. Ridder)
- 10.30 Messung und Bewertung operationeller Risiken
(P. Roßbach)
- 11.30 Kaffeepause
- 12.00 Methoden zum Vergleich von Score-Systemen
(A. Henking)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Evaluierung von Kreditratings
(G. Stahl)
- 15.30 Schlußdiskussion

4. Dresdner Risikotutorium (16.-17. 5. 2002)

Die Referenten

- *Dr. Uwe Gaumert:*
Abteilungsleiter
Bundesverband deutscher Banken e. V.
Bankenaufsicht, Risikomanagement, Markt- und Kreditrisiken
- *Dr. Andreas Henking:*
RiskSIM, München
- *Dr. Ralf Prinzler:*
Kreditanstalt für Wiederaufbau, Controlling/Bilanzen
- *Dr. Thomas Ridder:*
DZ BANK AG, Risiko-Controlling
- *Prof. Dr. Peter Roßbach:*
Wirtschafts- und Bankinformatik
Hochschule für Bankwirtschaft, Frankfurt am Main.
- *Gerhard Stahl:*
Oberregierungsrat
Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin), Bankenaufsicht, Referat D 2

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.

3. Dresdner Risikotutorium (7. - 8. 9. 2000)

Das Programm

Donnerstag, 7. September

- 15.⁰⁰ Uhr Begrüßung der Teilnehmer
Vortrag Herr Prof. Dr. Huschens:
„Markt- und Kreditrisikomodellierung: Parallelen und Unterschiede“
- 16.⁰⁰ Uhr Kaffeepause
- 16.³⁰ Uhr Vortrag Herr Dr. Gaumert:
„Anmerkungen zum spezifischen Risiko“
- 19.⁰⁰ Uhr Abendmenü

Freitag, 8. September

- 09.³⁰ Uhr Vortrag Herr Dr. Goebel:
„Das Kreditrisikomesssystem des Sparkassenverbandes“
- 10.³⁰ Uhr Vortrag Herr Prof. Dr. Oehler/ Herr Dr. Spellmann:
„Vergleichende Analyse von Markt- und Kreditrisikomodellen“
- 11.³⁰ Uhr Kaffeepause
- 12.⁰⁰ Uhr Vortrag Herr Dr. Ridder:
„Risikoprofile von Spread-Produkten“
- 13.⁰⁰ Uhr Mittagsmenü
- 14.⁰⁰ Uhr Vortrag Herr Stahl:
„CorporateMetrics – ein Überblick“
- 15.⁰⁰ Uhr Zusammenfassende Thesen und Schlußdiskussion
(alle Referenten)

2. Dresdner Risikotutorium (16.-17. 9. 1999)

Das Programm

Donnerstag 16. September

- 15.00 Begrüßung der Teilnehmer

Zum Stand des Einsatzes und der Prüfung interner Risikomodelle
(G. Stahl)
- 16.00 Begrenzung von Aktienkursrisiken mit VaR-Limiten
(L. Johanning)
- 17.00 Kaffepause
- 17.30 Konsistente VaR-Limitsysteme
(T. Ridder)
- 19.00 Abendmenü

Freitag, 17. September 1999

- 9.30 Limitbeanspruchung durch Derivate
(L. Overbeck)
- 10.30 Ein Simulationsansatz für nichtlineare Risiken mittels Hauptkomponenten
sowie die Behandlung von spezifischen Risiken
(H. Haaf)
- 11.30 Kaffepause
- 12.00 VaR-Ansätze bei der Kreditrisikomessung
(M. Wahrenburg)
- 13.00 Mittagmenü
- 14.30 Backtesting alt und neu
(G. Stahl)
- 15.30 Zusammenfassende Thesen und Schlußdiskussion (alle Referenten)

2. Dresdner Risikotutorium (16.-17. 9. 1999)

Die Referenten

- *Dr. Hermann Haaf:*
Finanzanalyst im Risikocontrolling der Dresdner Bank AG, Frankfurt, Referat Risikosystematik / Handel. Arbeitsgebiet: Markt- und Kreditrisikoquantifizierung, Pricing komplexer Finanzinstrumente.
- *Dr. Lutz Johanning:*
Wiss. Mitarbeiter an der Universität München am Seminar für Kapitalmarktforschung. Dissertation: Value-at-Risk zur Marktrisikosteuerung und Eigenkapitallokation.
- *Dr. Ludger Overbeck:*
Risikocontrolling Deutsche Bank AG, Frankfurt. Arbeitsgebiet: Quantitative Methoden für das Kreditportfolio. Vorher: LZB Nordrhein-Westfalen, Bankenaufsicht, Interne Modelle. Habilitation über stochastische Prozesse und Zinsstrukturmodelle.
- *Dr. Thomas Ridder:*
Leiter der Arbeitsgruppe „Risikomanagement / Bilanzstrukturberatung“ bei der SGZ-Bank AG. Arbeitsgebiet: Betreuung und Beratung von Banken in den Bereichen Risikomanagement, Bilanz- und Eigenanlagensteuerung. Vorher: Leiter der Arbeitsgruppe „Statistische Methoden“ in der Research-Abteilung.
- *Gerhard Stahl:*
Referent des Referates D 2 (Grundsatzfragen der Statistik interner Modelle) im Bundesaufsichtsamt für das Kreditwesen, Berlin. Zuständigkeit: statistische Methodik der Risikoquantifizierung, interne Modelle. Forschungsschwerpunkte: Stochastische Methoden des Risikomanagements, Regulatorische Statistik, Stochastik von Finanzzeitreihen.
- *Prof. Dr. Mark Wahrenburg:*
Inhaber des Lehrstuhls für Bankbetriebslehre an der Universität Frankfurt am Main. Forschungsschwerpunkte: Risikoregulierung von Banken, Modelle zu Quantifizierung von Markt- und Kreditrisiken.

Die Veranstalter

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

Dresdner Risikotutorium (6.-7. 3. 1998)

Das Programm

Freitag, 6. März 1998

- 13.30-13.45 Begrüßung der Teilnehmer
- 13.45-14.30 Aufsichtsrechtliche Rahmenbedingungen für die Zulassung interner Modelle (G. Stahl)
- 14.30-15.15 Überblick über alternative Ansätze zur Value-at-Risk-Bestimmung (S. Huschens)
- 15.15-15.30 Kaffepause
- 15.30-16.15 VaR-Bestimmung für lineare Risiken (G. Stahl)
- 16.15-17.00 VaR-Bestimmung für nichtlineare Risiken (H. Haaf)
- ab 17.00 Abendbuffet
- 18.20 Busabfahrt zur Semperoper
- 19.00 Beginn der Aufführung in der Semperoper

Samstag, 7. März 1998

- bis 9.30 Frühstücksbuffet
- 9.30-10.15 Monte-Carlo-Simulation (T. Ridder)
- 10.15-11.00 Besonderes Risiko und Risikomodelle (S. Huschens)
- 11.00-11.15 Kaffepause
- 11.15-12.00 Kreditrisiko und VaR (L. Overbeck)
- 12.00-12.45 Risikokonzepte (H. W. Brachinger)
- 12.45-14.00 Mittagsmenü
- 14.00-15.30 Zusammenfassende Thesen und Schlußdiskussion (alle Referenten)

Dresdner Risikotutorium (6.-7. 3. 1998)

Die Referenten

- *Prof. Dr. Hans Wolfgang Brachinger:*
Inhaber des Lehrstuhls für Statistik am Seminar für Statistik der Universität Freiburg, Schweiz. Habilitationsschrift zu Problemen der Risikomessung; Forschung, Lehre und Publikationen zur Risikomessung.
- *Dr. Hermann Haaf:*
Finanzanalyst im Risikocontrolling der Dresdner Bank AG, Frankfurt, Referat Risikosystematik / Handel; Arbeitsgebiet: Markt- und Kreditrisikoquantifizierung, Pricing komplexer Finanzinstrumente. Vorher: Entwicklung und Umsetzung eines Risikomanagementsystems im Projekt Risikomanagement / Handel, Südwestdeutsche Landesbank, Stuttgart.
- *Prof. Dr. Stefan Huschens:*
Inhaber des Lehrstuhls für Quantitative Verfahren, insbesondere Statistik an der Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, TU Dresden. Forschung, Vorträge und Veröffentlichungen zu statistischen Problemen der VaR-Schätzung und historischen Simulation.
- *Dr. Ludger Overbeck:*
Risikocontrolling Deutsche Bank AG, Frankfurt. Arbeitsgebiet: Quantitative Methoden für das Kreditportfolio. Vorher: LZB Nordrhein-Westfalen, Bankenaufsicht, Interne Modelle. Habilitation über stochastische Prozesse und Zinsstrukturmodelle.
- *Dr. Thomas Ridder:*
Leiter der Arbeitsgruppe „Beratung Risikomanagement“ bei der SGZ-Bank AG, Frankfurt und Stuttgart. Arbeitsgebiet: Betreuung und Beratung von Kreditinstituten in konzeptionellen und methodischen Fragen des Risikomanagement und -controlling. Vorher: Leiter der Arbeitsgruppe „Statistische Methoden“ in der Research-Abteilung.
- *Gerhard Stahl:*
Referent des Referates D2 (Grundsatzfragen der Statistik interner Modelle) im Bundesaufsichtsamt für das Kreditwesen, Berlin. Zuständigkeit: statistische Methodik der Risikoquantifizierung, interne Modelle.

Die Veranstalter

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