

Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät

Center for Applied Statistics and Economics (CASE)

Sonderforschungsbereich 649 der Deutschen Forschungsgemeinschaft

Ringvorlesung

„Die internationale Banken-, Kredit- und Finanzkrise:
Analyse, Ursachen, Lösungen“

Sind CDOs zu zähmen?

Prof. Dr. Wolfgang Härdle

CASE - Center for Applied Statistics and Economics



CDOs are structured financial products that allow for risk transfer. A portfolio's risk is divided into tranches of increasing seniority. According to risk preferences investors buy an exposure to portfolio default risk in exchange for a risk premium. Market data analysis shows model risk. These are explained and modern calibration tools are also presented.

Mittwoch, 28. Januar 2009, 18.00 Uhr

Raum 201

Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Spandauer Straße 1

Weitere Informationen auch unter <http://www.case.hu-berlin.de/>