

Einladung zum Kolloquium

Thema **Statistische Aspekte bei der Modellierung von Kredit-Portfolien**

Referent **Dr. Ludger Overbeck**  
Deutsche Bank, Risk Management, Frankfurt am Main

Datum, Zeit Donnerstag, 17. Mai 2001, 16.15 – ca. 17.30

Ort Hauptgebäude der Universität, Hörsaal **E 18**

### **Zusammenfassung**

Im Vortrag wird zunächst ein grundlegendes Modell für Kreditrisiken in grossen Portfolien vorgestellt. Dann werden die Problematik des zugrundeliegenden Faktormodells und die Schätzung der Korrelationsparameter in homogenen Portfolien angesprochen. Im letzten Teil des Vortrages wird auf die Modellvalidierung eingegangen.

**ACHTUNG:** Der Vortrag vom 28. Juni ist auf den **21. Juni** vorverschoben worden.

Auskunft Seminar für Statistik, ETH, 8092 Zürich  
Tel. 01 - 632 3438, [zukost@stat.math.ethz.ch](mailto:zukost@stat.math.ethz.ch)  
<http://stat.ethz.ch/zukost.html>

Einladung zum Kolloquium

Thema **Statistische Aspekte bei der Modellierung von Kredit-Portfolien**

Referent **Dr. Ludger Overbeck**  
Deutsche Bank, Risk Management, Frankfurt am Main

Datum, Zeit Donnerstag, 17. Mai 2001, 16.15 – ca. 17.30

Ort Hauptgebäude der Universität, Hörsaal **E 18**

### **Zusammenfassung**

Im Vortrag wird zunächst ein grundlegendes Modell für Kreditrisiken in grossen Portfolien vorgestellt. Dann werden die Problematik des zugrundeliegenden Faktormodells und die Schätzung der Korrelationsparameter in homogenen Portfolien angesprochen. Im letzten Teil des Vortrages wird auf die Modellvalidierung eingegangen.

**ACHTUNG:** Der Vortrag vom 28. Juni ist auf den **21. Juni** vorverschoben worden.

Auskunft Seminar für Statistik, ETH, 8092 Zürich  
Tel. 01 - 632 3438, [zukost@stat.math.ethz.ch](mailto:zukost@stat.math.ethz.ch)  
<http://stat.ethz.ch/zukost.html>