

AKTUARVEREINIGUNG ÖSTERREICHS

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT
FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

VIENNA INSTITUTE OF FINANCE

TECHNISCHE UNIVERSITÄT WIEN
FORSCHUNGSGRUPPE FÜR FINANZ-
UND VERSICHERUNGSMATHEMATIK

UNIVERSITÄT WIEN
FAKULTÄT FÜR MATHEMATIK

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Dr. Giovanni Cesari

Managing Director,
UBS Investment Bank London, Quantitative Risk Models and Statistics

Modelling, Pricing, and Hedging Counterparty Credit Exposure

During the current credit crisis it became clear that measuring, pricing, and hedging counterparty credit exposure for OTC derivatives is a fundamental part of the financial business. This talk gives an overview on what the challenges are in modelling counterparty credit exposure and computing credit valuation adjustments for all types of transactions across all asset classes.

Short CV: Dr. Giovanni Cesari is Managing Director at UBS. He works in DCEM (Derivatives Credit Exposure Management), a front office team responsible for computing and hedging counterparty credit exposure for the Investment Bank. Dr. Cesari graduated from the University of Trieste and received his Ph.D. from ETH in Zurich.

Termin: Dienstag, 20. Oktober 2009, 16:30 Uhr s.t.

Ort: **Technische Universität Wien**
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8–10
Freihaus, Turm B (gelber Bereich), 2. Stock,
Freihaus Hörsaal 3

Webseite: <http://www.fam.tuwien.ac.at/vr/>

Für Aktuarre zählt der Besuch des Vortrages als Weiterbildung (ein CPD-Punkt). Für eine entsprechende Bestätigung melden Sie sich bitte vorab per E-Mail mit Namen und Postanschrift im Sekretariat bei Herrn Christian Gawrilowicz (secr@fam.tuwien.ac.at) an.

Mag. Christoph Krischanitz
Präsident der Aktuarvereinigung Österreichs
Präsident des Österreichischen Förderungsvereins
der Versicherungsmathematik

Dkfm. Dr. Siegfried Sellitsch
Präsident der Österreichischen Gesellschaft
für Versicherungsfachwissen

Univ.-Prof. Dr. Uwe Schmock
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM)
Technische Universität Wien

o.Univ.-Prof. Walter Schachermayer
Institut für Mathematik, Universität Wien

Univ.-Prof. Dr. Damir Filipović
Vienna Institute of Finance