

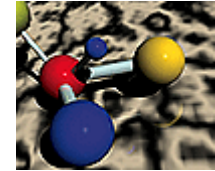
- Home
- Der WWTF
- Organisation
- MitarbeiterInnen
- Strategie
- Schwerpunkte und Instrumente
- Richtlinien
- Kontakt
- Links zu anderen Organisationen
  
- **Mathematik und... - Projektcall 2004**
- **ArbeitsgruppenleiterIn für Bioinformatik**
- **SciENCE for creative industries Call**
- **Life Sciences Call 2003**

## Mathematik und Kreditrisiken

### **Projektleiter: Prof. Walter Schachermayer (Institut für Wirtschaftsmathematik der Technischen Universität Wien)**

Partner: Prof. Stefan Pichler (Institut für Kreditwirtschaft der Wirtschaftsuniversität Wien)  
Prof. Uwe Schmock (Institut für Wirtschaftsmathematik der Technischen Universität Wien)  
Prof. Markus Fulmek (Institut für Mathematik der Universität Wien)

Die Methoden der stochastischen Finanzmathematik sollen verstärkt für das Management von Kreditrisiken eingesetzt werden - mit dem Stichwort Basel II ein sehr relevantes Thema. Verschiedene Aspekte des Risiko-Managements im Kreditbereich sollen mathematisch modelliert werden und durch die interdisziplinäre Zusammensetzung des Projektteams sollen diese Modelle auch in die praktische Umsetzung gelangen. Mittelfristige Anwendungen werden insbesondere für das optimale Design von Kredit-Derivativen erwartet.  
(Fördersumme 500.000 Euro / Projektdauer 4 Jahre)



Login