



Credit Risk Evaluation  
Designed for Institutional  
Targeting in finance

# Dependence Modelling for Credit Portfolios

22-23 settembre 2003

Auditorium Santa Margherita  
Venezia



## RELATORI INVITATI

- **Mark H.A. Davis** (Imperial College, London)  
*Infection Methods for Dynamic Modelling of Portfolio Default Risk*
- **Greg M. Gupton** (Moody's|KMV, New York)  
*Advancing Loss Given Default Forecasting Models: How the Quiet Quicken*
- **Philipp Schönbucher** (ETH, Zurich)  
*Information-driven Default Contagion and Default Correlation*
- **Stuart M. Turnbull** (Lehman Brothers, New York)  
*Issues In Calibration*
- **Thomas C. Wilson** (Oliver Wyman & Co., New York)  
*Challenges for Modelling Credit Risk Over the Cycle: Management, Capital and Regulatory Perspectives*

## COMITATO SCIENTIFICO

- Paul Embrechts**  
*ETH, Zurich (Program Chair)*
- Mark H.A. Davis**  
*Imperial College, London*
- Philipp Schönbucher**  
*ETH, Zurich*
- Stuart M. Turnbull**  
*Lehman Brothers, New York*

SEGRETERIA  
ORGANIZZATIVA

OLTREX 4M SpA  
Tel. +39.041.5242840/5242828  
Fax +39.041.5221986  
reservation@venicesystem.com

Poster Session

Servizio di traduzione  
simultanea

Tavola rotonda:

“Effetti di portafoglio e migrazione dei meriti creditizi alla luce di Basilea 2”

<http://www.greta.it/credit/credit2003/credit2003.htm>

Sponsor



UNIVERSITÀ  
CA' FOSCARI  
VENEZIA  
DIPARTIMENTO  
DI SCIENZE  
ECONOMICHE



Con il patrocinio