

Prof. Dr. Mario Straßberger
Professur für Betriebswirtschaftslehre,
insbes. Finanzwirtschaft und Finanzdienstleistungen
Hochschule Zittau/Görlitz

Verzeichnis wissenschaftlicher Vorträge

Beiträge auf Tagungen (mit Begutachtungsverfahren)

Diversification Benefits and Hedging Abilities of Crypto Assets in Equities Portfolios, International Conference on Operations Research (OR 2024), 03.–06. September 2024, Technische Universität München.

Credit risk and graph-based modelling of obligors micro-structural relations, International Conference on Operations Research (OR 2018), 11.–14. September 2018, Universite libre de Bruxelles, Belgien.

How to Improve Credit Risk Models? A Conceptional Design at Graph Theory and Semantic Web, International Conference on Operations Research (OR 2013), 3.–6. September 2013, Erasmus Universität Rotterdam, Niederlande [zusammen mit T. Rex].

Yield Spreads, Value of Bonds, and Implications for Liquidity Management – An Empirical Analysis during the Crisis, International Conference on Competition in Banking: Theory and Practice, 24.–25. Mai 2012, Ukrainische Bankakademie Sumy, Ukraine.

Return Spreads and Bond Values During the Crisis – An Empirical Analysis, International Conference on Operations Research (OR 2010), 1.–3. September 2010, Universität der Bundeswehr München.

Capital Requirement, Portfolio Risk Insurance, and Dynamic Risk Budgeting, Annual Meeting of the European Financial Management Association (EFMA), 29. Juni–2. Juli 2005, Mailand, Italien.

Risk Capital Allocation in Trading Divisions of Financial Institutions, 11th

Annual Conference of the German Finance Association, 1.–2. Oktober 2004, Eberhard-Karls-Universität Tübingen.

Managing Risk in Changing Financial Markets, VIIth World Congress of the International Federation of Scholarly Associations of Management (IFSAM), 5.–7. Juli 2004, Göteborg, Schweden.

Implicit Portfolio Insurance and Dynamic Risk Budgeting, 66. Wissenschaftliche Jahrestagung des Verbands der Hochschullehrer für Betriebswirtschaft, 1.–4. Juni 2004, Karl-Franzens-Universität Graz, Österreich.

Risikolimitsystem und –kapitalallokation für Handelsdivisionen von Finanzinstituten, 66. Wissenschaftliche Jahrestagung des Verbands der Hochschullehrer für Betriebswirtschaft, 1.–4. Juni 2004, Karl-Franzens-Universität Graz, Österreich.

Profit & Loss-Dependent Market Risk Budgeting with Implicit Options, 7th Conference of the Swiss Society for Financial Market Research, 2. April 2004, SWX Zürich, Schweiz.

Risk Capital Allocation in Trading Divisions of Financial Institutions, 2nd European Risk Management Conference, 29.–30. März 2004, Universität Antwerpen, Belgien.

How to Control Market Risk Dynamically by Setting Risk Limits?, International Conference on Operations Research (OR 2003), 3.–5. September 2003, Ruprecht-Karls-Universität Heidelberg.

Verfahren zur Risikokapitalallokation im Eigenhandel von Banken, International Conference on Operations Research (OR 2002), 2.–5. September 2002, Universität Klagenfurt, Österreich.

Marktpreisrisikoschätzung in Portefeuilles mit nichtlinearen Verlustfunktionen, 3. Tagung Informationssysteme in der Finanzwirtschaft (IF 2001), 19.–21. September 2001, Universität Augsburg.

Schätzung des Marktrisikos von Portefeuilles aus Aktien und Aktienoptionen, International Conference on Operations Research (OR 2000), 9.–12.

September 2000, Technische Universität Dresden.

Beiträge auf Tagungen (teilweise mit Begutachtungsverfahren)

Holding Bitcoin in German Equities Portfolios, Symposium Modern Finance and Risk Management, 19. Mai 2022, Technische Universität Dresden.

Improving credit risk models by modelling debtor's dependencies via graphs, 5th Scientific Conference Finance and Accounting, 24.–26. April 2017, University of Economics Breslau, Jelenia Gora, Polen.

Bond Yield Spreads During the Financial Crisis – Implications for Liquidity Risk Management, 3rd International Scientific Conference on Financial Markets of Europe and Russia, 18.–19. April 2012, Universität für Wirtschaft und Finanzen St. Petersburg, Russland.

Risk, Risk Capital and Consistent Systems of Risk Limits, 28th Annual Conference of the German Classification Society (GfKl 2004), 9.–11. März 2004, Universität Dortmund.

Continuous Market Risk Budgeting in Financial Institutions, 28th Annual Conference of the German Classification Society (GfKl 2004), 9.–11. März 2004, Universität Dortmund.

How to Allocate Risk Capital in a Bank's Trading Division?, 4. Workshop der GOR-Arbeitsgruppe "Finanzwirtschaft und Finanzinstitutionen", 23. Mai 2003, Allianz AG München.

Forschungs- und sonstige Beiträge

Diversifikations- und Hedging-Eigenschaften von Kryptoassets in Aktienportfolios, Zwölfte Jahrestagung des Arbeitskreises Finanzierung, 16. Juni 2024, Touro University Berlin.

Graphen zur Modellierung von Abhängigkeiten zwischen Schuldnern in Kreditrisikomodellen, Sechste Jahrestagung des Arbeitskreises Finanzierung, 22.

Juni 2018, International School of Management München.

Auswirkungen der Umstellung der Konzernrechnungslegung von HGB auf IFRS auf Bilanzkennzahlen und Bilanzrating, Erste Jahrestagung des Arbeitskreises Finanzierung, 31. Mai 2013, Fachhochschule Stralsund.

Asset Liability Management, Risk Management Information Exchange 2008, European Investment Bank Luxemburg.

Behavioral Corporate Finance, Forschungsseminar SS 2005, Friedrich-Schiller-Universität Jena.

Unternehmensfinanzierung und beschränkte Rationalität, Forschungsseminar WS 2004/2005, Friedrich-Schiller-Universität Jena.

Modellierung extremer Ereignisse in Finanzzeitreihen — Anwendungen im Risikomanagement, Forschungsseminar WS 2003/2004, Friedrich-Schiller-Universität Jena.

Extremwerttheorie und Modellierung extremer Risiken in Finanzportefeuilles, Forschungsseminar SS 2003, Friedrich-Schiller-Universität Jena.

Risikokapitalallokation und Marktpreisrisikosteuerung in Banken, Seminar des HypoVereinsbank-Stiftungsfonds zur Förderung bankwissenschaftlicher Nachwuchskräfte, 27.–28. Oktober 2000, Humboldt-Universität zu Berlin.

Koreferate und Besprechungen

”Corporate Hedging Policy and Equity Mispricing” by J.B. Lin, C. Pantzalis and J.C. Park, Annual Meeting of the European Financial Management Association (EFMA), 29. Juni–2. Juli 2005, Mailand, Italien.

”Voluntary Debt Reductions” by T. Dangl and J. Zechner, 11th Annual Conference of the German Finance Association, 1.–2. Oktober 2004, Eberhard-Karls-Universität Tübingen.

”Prognoseunsicherheit und Informationswirkung am Beispiel der Unterneh-

mensbewertung” von A. Vincenti, Seminar des HypoVereinsbank-Stiftungsfonds zur Förderung bankwissenschaftlicher Nachwuchskräfte, 23.–24. April 2004, Ernst-Moritz-Arndt-Universität Greifswald.

”FDI versus cross-border financial services ...” by C. M. Buch and A. Lipponer, 7th Conference of the Swiss Society for Financial Market Research, 2. April 2004, SWX Zürich, Schweiz.

”Risk Capital Allocation using Value at Risk Limits ...” by T. Dresel et al., 10th Annual Conference of the German Finance Association, 10.–11. Oktober 2003, Johannes-Gutenberg-Universität Mainz.