

AWG - Austrian Working Group on Banking and Finance

30. Workshop am 27. und 28. November 2015

Der Workshop findet am Freitag, 27. November 2015 (Nachmittag)
im Festsaal des Meerscheinschlössls, Mozartgasse 3 und
am Samstag, 28. November 2015 (Vormittag)
an der Karl-Franzens-Universität Graz, Universitätsstraße 15, Sektor F, 2. Stock statt.

Programm

(Stand: 27.10.2015)

Freitag, 27.11.2015 Meerscheinschlössl

- 14:00 **Eröffnung:**
Univ.-Prof. Dr. Thomas Foscht, Dekan SOWI, Universität Graz,
MMag. Martin Schaller, Generaldirektor, RLB Steiermark
Univ.-Prof. Dr. Peter Steiner, Vorstand Institut für Banken und Finanzierung,
Universität Graz
- 14:20 – 15:50 **Session I:**
Zeitstruktur der Non-Performing-Loans österreichischer Kreditinstitute
Paul Ehrlich, OeNB / Norbert Ernst, OeNB
Securitization, Shadow Banking, and Bank Regulation
Julian Kolm, WU Wien
Dynamics of retail-bank branching in Austria
Johann Burgstaller, Uni Linz
- 15:50 – 16:05 *Pause*
- 16:05 – 17:05 **Session II:**
Comparing Maximum Sharpe Ratios and Incremental Variable Testing
Michael Hanke, Uni Lichtenstein / Spiridon Penev, Uni New South Wales
Investment Horizons and Price Indeterminacy in Financial Markets
Shinichi Hirota, Uni Waseda / Jürgen Huber, Uni Innsbruck / Thomas Stöckl,
Uni Innsbruck / Shyam Sunder, Yale School of Management
- 17:30 **Podiumsdiskussion: Wieviel Wissenschaft benötigen die Banken von morgen?**
- 19:00 **Vergabe des *AWG Best Paper Award***

**Ab 20:00 Abendessen und geselliges Beisammensein im
Restaurant THOMAWIRT – Leonhardstraße 40-42, 8010 Graz**

Samstag, 28.11.2015

9:00 – 10:30 **Session IIIa (parallel zu Session IIIb), Seminarraum 15.25/F2**

DCC-GARCH Market Impact Modelling in High Frequency Trading

Stephan Unger, Uni Wien / William Cheung, Uni Macau

Commonality in Liquidity Dimensions: The Impact of Financial Crisis and Regulation NMS

Julia Elizabeth Reynolds, Uni Wien

Intraday causalities in response to U.S. macroeconomic news announcements: Evidence from Central Europe

Henryk Gurgul, AGH Uni Krakau / Lukasz Lach, AGH Uni Krakau / Tomasz Wójtowicz, AGH Uni Krakau

9:00 – 10:30 **Session IIIb (parallel zu Session IIIa), Seminarraum 15.24/E2**

The Covered Interest Rate Parity and Market Dislocations

Julia Reynolds, WU Wien / Leopold Sögner, WU Wien / Martin Wagner, TU Dortmund / Dominik Wied, TU Dortmund

The affine inflation market models

Stefan Waldenberger, TU Graz

MiFID & MIFIR Interessenkonflikte

Ulrike Bergmann, Kommunalkredit Austria AG

10:30 – 10:45 *Pause*

10:45 – 12:15 **Session IV, Seminarraum 15.25/F2**

Does Merging Two Asset Pricing Anomalies Increase Returns while Reducing Risk?

Matthias Pachler, Uni Graz

Kann man den Markt systematisch schlagen? Eine empirische Analyse der ZZ Fonds

Engelbert J. Dockner, WU Wien / Stephan Kranner, WU Wien

Nonparametric Prediction of Stock Returns Based on Yearly Data: The Long-Term View

Michael Scholz, Uni Graz / Jens Perch Nielsen, Cass Business School / Stefan Sperlich, Uni Genf

Anmeldung unter: <http://goo.gl/forms/rwCNin9HK4>

Weiterführende Informationen: awg30@uni-graz.at, Tel. (0316) 380 7300