



# Versicherungs- und Finanzmathematik

## LUH Kolloquium

Im Forschungskolloquium des Leibniz Lab of Insurance and Financial Mathematics und des Instituts für Mathematische Stochastik tragen Wissenschaftler und Praktiker über aktuelle Themen aus dem Bereich Versicherungs- und Finanzmathematik vor. Das Kolloquium richtet sich gleichermaßen an Studierende und Wissenschaftler sowie Praktiker und bietet ein Forum für den Austausch zwischen Wissenschaft und Wirtschaft.

### Zeit:

Donnerstag, 17.06.2010  
17.30 - 18.30 Uhr

### Ort:

Institut für Mathematische Stochastik  
Leibniz Universität Hannover  
Welfengarten 1  
30167 Hannover  
Hörsaal F428



### Organisation:

Prof. Dr. Ludwig Baringhaus  
Prof. Dr. Rudolf Grübel  
Prof. Dr. Stefan Weber  
Dr. Thomas Knispel

### Kontakt:

Dr. Thomas Knispel  
knispel@stochastik.uni-hannover.de  
Tel.: 0511/762 4249

### Nächster Vortrag:

**Prof. Dr. Christian Hipp (Universität Karlsruhe (TH))**

spricht zum Thema

### Dynamische Steuerung in Versicherungsmodellen

**Inhalt:** Die dynamische Steuerung in Versicherungsmodellen ist ein seit gut zehn Jahren aktives Forschungsgebiet der angewandten Mathematik, in dem neue mathematische Probleme auftreten und einige bis heute ungelöste anwendungsorientierte Fragestellungen vorhanden sind. Als Beispiele solcher Probleme und Fragestellungen werden behandelt:

- 1.) die Lösung einer Integro-Differentialgleichung mit Singularität und
- 2.) die Lösung einer Hamilton-Jacobi-Bellman-Gleichung mit Integralterm.

Mit den dort entwickelten Techniken wird das Problem untersucht, die Ruinwahrscheinlichkeit eines Versicherungsunternehmens mit Investment und mit limitierter XL-Rückversicherung zu minimieren.

Abschließend werden zwei besonders interessante Problemgruppen erwähnt, für welche es mittlerweile auch Lösungsansätze gibt: die dynamische Steuerung in Mischungsmodellen und die dynamische Steuerung mit mehreren Zielfunktionen.

### Interessenten sind herzlich eingeladen !

Ab 17.00 Uhr findet im Raum F 448 ein Empfang bei Kaffee und Gebäck statt.

Weitere Informationen zum Kolloquium und zur Anfahrt:

[www.stochastik.uni-hannover.de](http://www.stochastik.uni-hannover.de)

Weitere Informationen zum Leibniz Lab:

[www.leibniz-lab.de](http://www.leibniz-lab.de)

# Versicherungs- und Finanzmathematik

## Vorträge im Sommersemester 2010

- 22.04.2010     **Dr. Stefan Jaschke**  
(Munich Re)
- 07.05.2010     **Prof. Dr. Axel Munk**  
(Georg-August-Universität Göttingen)
- 07.05.2010     **Prof. Dr. Markus Reiß**  
(Humboldt-Universität zu Berlin)
- 03.06.2010     **Prof. Dr. Moritz Kaßmann**  
(Universität Bielefeld)
- 17.06.2010     **Prof. Dr. Christian Hipp**  
(Universität Karlsruhe)
- 07.07.2010     **Prof. Dr. Holger Drees**  
(Universität Hamburg)
- 08.07.2010     **Prof. Dr. Michael Kupper**  
(Humboldt-Universität zu Berlin)

**Interessenten sind herzlich eingeladen !**

Weitere Informationen zu den Vorträgen:

**[www.stochastik.uni-hannover.de](http://www.stochastik.uni-hannover.de)**